

CM-CIC HIGH YIELD 2024

DOCUMENTO DE INFORMACIÓN SEMESTRAL A 30/09/2020
--

FORMA JURÍDICA DEL OIC

SICAV general

CLASIFICACIÓN

Clasificación del BCE Fondo de renta fija

ASIGNACIÓN DE RESULTADOS

Resultado de capitalización y de reparto

ESTADO DEL PATRIMONIO

Componentes del estado del patrimonio	Importe al cierre del periodo*
a) Valores financieros admisibles mencionados en el punto 1.º del apartado I del artículo L. 214-20 del Código Monetario y Financiero francés	162.765.242,38
b) Activos bancarios	1.527.843,05
c) Otros activos del OICVM	16.341.405,89
d) Total de activos del OICVM	180.634.491,32
e) Pasivo	-62.540,09
f) Valor de inventario neto	180.571.951,23

* Importes certificados

NÚMERO DE PARTICIPACIONES EN CIRCULACIÓN Y VALOR DE INVENTARIO NETO POR PARTICIPACIÓN O ACCIÓN

Participación	Tipo de participación	Patrimonio neto	Número de participaciones en circulación	Valor liquidativo
C1 CM CIC H.Y.24 RC3D	De capitalización	104.211.217,33	1.049.091,023	99,33
C3 CM CIC H.Y.24 S 3D	De capitalización	54.637.997,93	547.767,777	99,74
D1 CM CIC H.Y.24 RD3D	De reparto	2.466.787,59	25.651,114	96,16
I1 CM CI.H.Y.24 IC 3D	De capitalización	19.255.948,38	201,01	95.795,97

COMPONENTES DE LA CARTERA DE VALORES

Componentes de la cartera de valores:	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
a) Valores financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en un mercado regulado según lo dispuesto en el artículo L. 422-1	90,14	90,11
b) Valores financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a negociación en otro mercado regulado, con funcionamiento periódico, reconocido, abierto al público y que tenga su domicilio social en un Estado miembro de la Unión Europea o en otro Estado que forme parte del Acuerdo sobre el Espacio Económico Europeo (EEE)	0,00	0,00
c) Valores financieros admisibles e instrumentos del mercado monetario admitidos a cotización oficial en una bolsa de valores de un tercer país o negociados en otro mercado de un tercer país regulado, con funcionamiento periódico, reconocido y abierto al público, siempre que dicha bolsa o mercado no figure en una lista elaborada por la Autoridad de los Mercados Financieros o que la elección de dicha bolsa o mercado esté prevista por la ley o el reglamento o los estatutos del organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios	0,00	0,00
d) Valores financieros de reciente emisión que se indican en el punto 4.º del apartado I del artículo R. 214-11 del Código Monetario y Financiero francés	0,00	0,00
e) Otros activos	8,97	8,96

DESGLOSE DE LOS ACTIVOS DE LOS APARTADOS A), B) Y F) DEL ARTÍCULO R.214-1-1 POR DIVISA

Valores	Divisa	En importe (EUR)	Porcentaje	
			Patrimonio neto	Total de activos
SAIPEM FI 2,625%25	EUR	4.009.652,13	2,23	2,21
ORANO 4,875%09-24	EUR	3.899.147,19	2,16	2,16
TEL.ITA. 4%110424	EUR	3.788.394,73	2,10	2,10
INTRUM 3,125%24	EUR	3.337.789,09	1,85	1,85
SOFTBANK GROU 4%23	EUR	3.165.300,00	1,75	1,75
TEVA PH.F.NL.II 16	EUR	3.078.286,43	1,70	1,70
ALTICE FRA 2,5%25	EUR	2.905.671,67	1,61	1,61
THYSSENK 2,875%24	EUR	2.878.731,23	1,59	1,59
PETROBRAS 4,75%25	EUR	2.865.331,83	1,59	1,59
LEONARDO 4,875%25	EUR	2.861.434,59	1,58	1,58
UNIPOL 3%180325	EUR	2.661.709,93	1,47	1,47
EUROFINS 2,125%24	EUR	2.637.892,81	1,46	1,46
IQVIA 3,25%25	EUR	2.525.886,81	1,40	1,40
INTER GAME 3,5%24	EUR	2.497.490,28	1,38	1,38
WEBUILD 1,75%24	EUR	2.473.246,89	1,37	1,37
ADLER REA 2,125%24	EUR	2.445.340,92	1,35	1,35
LOXAM 3,25%0125	EUR	2.386.136,81	1,32	1,32
HANESBR.FIN.LU 16/	EUR	2.370.178,75	1,31	1,31
DUFY ONE 2,5%24	EUR	2.204.618,06	1,22	1,22
SMURF.KAPP.ACQ.15/	EUR	2.124.139,44	1,18	1,18
UBI BANCA 2,625%24	EUR	2.117.438,90	1,17	1,17
AVANT INC 4,75%24	EUR	2.074.403,89	1,15	1,15
SPIE 3,125%220324	EUR	2.073.979,18	1,15	1,15
DEUTSCHE B 2,75%25	EUR	2.065.442,29	1,14	1,14
BANCO BPM 2,5%24	EUR	2.064.089,59	1,14	1,14
INGENICO 1,625%24	EUR	2.060.091,78	1,14	1,14
ERAMET 4,196%24	EUR	2.049.470,60	1,13	1,13
JAGUAR L 5,875%24	EUR	2.045.598,80	1,13	1,13
ILIAD 1,5%141024	EUR	2.008.056,39	1,11	1,11
NEXI 1,75%311024	EUR	1.991.857,78	1,10	1,10
BANCO SAB 1,75%24	EUR	1.991.224,11	1,10	1,10
GRIFOLS 1,625%25	EUR	1.985.163,05	1,10	1,10
NEMAK 3,25%150324	EUR	1.965.629,44	1,09	1,09
PET. MEX. 17/24 MT	EUR	1.944.641,64	1,08	1,08
RENAULT 1%180424	EUR	1.907.190,68	1,06	1,06
K+S AG ANL.	EUR	1.885.694,25	1,04	1,04
ARCELORMI 2,25%24	EUR	1.862.463,84	1,03	1,03
NEXANS 2,75%050424	EUR	1.852.238,96	1,03	1,03
FIAT CHRYS 3,75%24	EUR	1.833.470,96	1,02	1,02
QUATRIM 5,875%24	EUR	1.769.935,75	0,98	0,98
CROWN EUROPEAN HLG	EUR	1.745.433,92	0,97	0,97
PLAYTECH 3,75%23	EUR	1.730.852,17	0,96	0,96
OCI 3,125%011124	EUR	1.718.508,98	0,95	0,95
CEMEX 2,75%051224	EUR	1.708.223,75	0,95	0,95
MEDIOBANCA 5,75%23	EUR	1.689.717,30	0,94	0,94

Valores	Divisa	En importe (EUR)	Porcentaje	
			Patrimonio neto	Total de activos
BERRY GLOBAL 1%25	EUR	1.642.092,46	0,91	0,91
COTY 4%150423	EUR	1.636.860,55	0,91	0,91
MPT 3,325%240325	EUR	1.597.215,62	0,88	0,88
OI EUROPEAN GRP 16	EUR	1.538.943,54	0,85	0,85
AXALTA CSD 3,75%25	EUR	1.523.086,25	0,84	0,84
BANKIA 1%250624	EUR	1.513.218,49	0,84	0,84
FNAC DAR 1,875%24	EUR	1.508.556,25	0,84	0,84
FORD MOT 3,021%24	EUR	1.500.241,64	0,83	0,83
ELIS 1,75%110424	EUR	1.493.598,70	0,83	0,83
BANIJAY EN 3,5%25	EUR	1.471.955,83	0,82	0,81
LINCOLN 3,625%24	EUR	1.445.341,04	0,80	0,80
Q-PARK HLDG 1,5%25	EUR	1.376.012,50	0,76	0,76
URW 0%15 ORN.	EUR	1.369.556,00	0,76	0,76
ROLLS-ROY 0,875%24	EUR	1.316.685,00	0,73	0,73
VOLVO CAR 2%240125	EUR	1.301.820,64	0,72	0,72
AIR FRAN 1,875%25	EUR	1.273.894,44	0,71	0,71
PICARD GROUPE TV23	EUR	1.267.452,33	0,70	0,70
INDRA SISTEMA 3%24	EUR	1.229.512,60	0,68	0,68
ACCOR 1,25%24	EUR	1.194.050,88	0,66	0,66
QUADIENT 2,25%25	EUR	1.180.314,16	0,65	0,65
EIRCOM FI 1,75%24	EUR	1.168.776,33	0,65	0,65
BILFINGER 4,5%24	EUR	1.153.227,64	0,64	0,64
CRED.AGR.3%14 TSR	EUR	1.083.739,18	0,60	0,60
CELLNEX T 2,375%24	EUR	1.072.001,58	0,59	0,59
NOMAD FOOD 3,25%24	EUR	1.027.108,89	0,57	0,57
UNITED GR 4,875%24	EUR	1.024.217,08	0,57	0,57
PIRELLI C 1,375%23	EUR	1.006.239,64	0,56	0,56
MATTERHO 2,625%24	EUR	979.289,58	0,54	0,54
NIDDA HLTHC 3,5%24	EUR	978.554,44	0,54	0,54
AUTOSTRAD 1,625%23	EUR	975.926,30	0,54	0,54
ZF EU FIN 1,25%23	EUR	964.432,79	0,53	0,53
PAPREC HOLDIN 4%25	EUR	964.024,44	0,53	0,53
STENA INTL 3,75%25	EUR	955.524,17	0,53	0,53
TEREOS F 4,125%-23	EUR	941.335,48	0,52	0,52
DKT FINANCE 7%23	EUR	930.948,00	0,52	0,52
ADIENT GLB 3,5%24	EUR	929.325,22	0,51	0,51
MOBILUX FIN 5,5%24	EUR	927.810,50	0,51	0,51
CMA CGM 5,25%25	EUR	916.614,17	0,51	0,51
AVIS BUDG 4,125%24	EUR	901.287,92	0,50	0,50
GRUPO ANTO 3,25%24	EUR	865.432,22	0,48	0,48
KAEFER NTS.18/24RE	EUR	858.661,00	0,48	0,48
3AB OPTIQ.DEV 4%23	EUR	779.888,89	0,43	0,43
HAPAG-LLO 5,125%24	EUR	728.407,26	0,40	0,40
BURGER KING F 6%24	EUR	706.801,67	0,39	0,39
OUTOKUMPU 4,125%24	EUR	701.208,67	0,39	0,39
GESTAMP FDG 3,5%23	EUR	683.367,61	0,38	0,38
INEOS FIN 5,375%24	EUR	606.784,58	0,34	0,34
PPF TELE 3,5% 0524	EUR	521.692,60	0,29	0,29

Valores	Divisa	En importe (EUR)	Porcentaje	
			Patrimonio neto	Total de activos
LA FIN. ATALI 4%24	EUR	519.001,33	0,29	0,29
BEL 1,5%24	EUR	517.626,51	0,29	0,29
AIB GROUP 1,25%24	EUR	510.669,66	0,28	0,28
METRO MTN 15/25	EUR	510.352,95	0,28	0,28
KRAFT HEINZ 1,5%24	EUR	505.731,78	0,28	0,28
BK OF IE 0,75%24	EUR	501.003,56	0,28	0,28
MAHLE 2,375%200522	EUR	499.752,12	0,28	0,28
SISAL GP 7%310723	EUR	210.870,11	0,12	0,12
TOTAL	EUR	162.765.242,38	90,14	90,11
TOTAL		162.765.242,38	90,14	90,11

DESGLOSE DE LOS ACTIVOS DE LOS APARTADOS A), B) Y F) DEL ARTÍCULO R.214-1-1 POR SECTOR ECONÓMICO

Sector económico	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
Finanzas generales	13,78	13,76
Automóviles y fabricantes de piezas de repuesto	7,16	7,16
Servicios de apoyo a las empresas	7,11	7,11
Bancos	6,56	6,56
Industria farmacéutica y biotecnología	5,96	5,95
Inversiones inmobiliarias y servicios	4,80	4,80
Otros sectores económicos	44,77	44,77
TOTAL	90,14	90,11

DESGLOSE DE LOS ACTIVOS DE LOS APARTADOS A), B) Y F) DEL ARTÍCULO R.214-1-1 POR PAÍS DE RESIDENCIA DEL EMISOR

País	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
FRANCIA	23,69	23,69
PAÍSES BAJOS	12,55	12,54
ITALIA	12,10	12,09
OTROS PAÍSES	41,80	41,79
TOTAL	90,14	90,11

DESGLOSE DE OTROS ACTIVOS POR TIPO

Tipo de activo	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
PARTICIPACIONES DE OIC	8,97	8,96
▪ OIC y Fondos de inversión de tipo general (no profesionales)	8,97	8,96
▪ FCPR, FCPI y FIP abiertos a inversores no profesionales	0,00	0,00
▪ Organismo de titulización	0,00	0,00
▪ OPCI y SCPI abiertos a inversores no profesionales	0,00	0,00
▪ SEF, SICAF y fondos de inversión alternativos	0,00	0,00
▪ Fondos profesionales de tipo general (abiertos a inversores profesionales)	0,00	0,00
▪ OPCI profesionales, Fondos profesionales especializados y fondos profesionales de capital riesgo (private equity)	0,00	0,00
▪ Otras inversiones colectivas	0,00	0,00
OTROS TIPOS DE ACTIVOS	0,00	0,00
▪ Bonos de suscripción	0,00	0,00
▪ Bonos de caja	0,00	0,00
▪ Pagarés	0,00	0,00
▪ Cédulas hipotecarias	0,00	0,00
▪ Otros	0,00	0,00
TOTAL	8,97	8,96

MOVIMIENTOS EN LA CARTERA DE VALORES DURANTE EL PERIODO

Movimientos registrados durante el periodo	Movimientos (en importe)
Adquisiciones	9 034 149,93
Cesiones	6 167 918,88

REPARTO DURANTE EL PERIODO EN CURSO

		Importe unitario en EUR			
	Participación	Porcentaje del resultado	Porcentaje de las plusvalías netas	Total unitarios	Crédito de impuestos
Dividendos pagados					
	D1 PART DIST RD	0,00	0,00	0,00	0,00
Dividendos por pagar					
	D1 PART DIST RD	0,00	0,00	0,00	0,00

DETALLE DE LA CARTERA DE VALORES

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% Patrimonio neto
TOTAL Bonos y valores similares						162.765.242,38	90,13
TOTAL Bonos y valores similares negociados en un mercado regulado o similar						162.765.242,38	90,13
TOTAL Bonos de tipo de fijo negociados en un mercado regulado o similar						155.289.335,28	85,99
TOTAL ALEMANIA						11.938.721,81	6,61
DE000A2NB965 KAEFER ISOLIERTECHN 5,5%18-24	24/07/2018	10/01/2024	EUR	900	5,50	858.661,00	0,48
DE000A2TEDB8 THYSSENKRUPP 2,875%19-220224	22/02/2019	22/02/2024	EUR	3.000	2,875	2.878.731,23	1,60
DE000A2YNQW7 BILFINGER 4,5%19-140624	14/06/2019	14/06/2024	EUR	11	4,50	1.153.227,64	0,64
XS1203941775 METRO 1,5%15-190325	19/03/2015	19/03/2025	EUR	500	1,50	510.352,95	0,28
XS1233299459 MAHLE 2,375%15-200522	20/05/2015	20/05/2022	EUR	500	2,375	499.752,12	0,28
XS1645113322 HAPAG-LLOYD 5,125%17-150724	18/07/2017	15/07/2024	EUR	700	5,125	728.407,26	0,40
XS1690644668 NIDDA HLTHC HLD 3,5%17-300924	29/09/2017	30/09/2024	EUR	1.000	3,50	978.554,44	0,54
XS1731858715 ADLER REAL ESTATE 2,125%17-24	06/12/2017	06/02/2024	EUR	2.500	2,125	2.445.340,92	1,35
XS1854830889 K S 3,25%18-180724	18/07/2018	18/07/2024	EUR	20	3,25	1.885.694,25	1,04
TOTAL DINAMARCA						930.948,00	0,52
XS1841967356 DKT FINANCE 7%18-170623	02/07/2018	17/06/2023	EUR	900	7,00	930.948,00	0,52
TOTAL ESPAÑA						8.656.552,05	4,79
ES0313307219 BANKIA 1%19-250624	25/06/2019	25/06/2024	EUR	15	1,00	1.513.218,49	0,84
XS1468525057 CELLNEX TELECOM 2,375%16-0124	10/08/2016	16/01/2024	EUR	10	2,375	1.072.001,58	0,59
XS1598243142 GRUPO ANTOLIN 3,25%17-300424	21/04/2017	30/04/2024	EUR	1.000	3,25	865.432,22	0,48
XS1809245829 INDRA SISTEMAS 3%18-190424	19/04/2018	19/04/2024	EUR	12	3,00	1.229.512,60	0,68
XS1991397545 BANCO SABADELL 1,75%19-100524	10/05/2019	10/05/2024	EUR	20	1,75	1.991.224,11	1,10
XS2076836555 GRIFOLS 1,625%19-150225	15/11/2019	15/02/2025	EUR	2.000	1,625	1.985.163,05	1,10
TOTAL FINLANDIA						701.208,67	0,39
FI4000331004 OUTOKUMPU 4,125%24	18/06/2018	18/06/2024	EUR	700	4,125	701.208,67	0,39
TOTAL FRANCIA						39.052.826,18	21,63
FR0010804500 ORANO 4,875%09-230924 EMTN	23/09/2009	23/09/2024	EUR	70	4,875	3.899.147,19	2,15
FR0013183571 TEREOS FIN 4,125%16-160623	16/06/2016	16/06/2023	EUR	10	4,125	941.335,48	0,52
FR0013233384 ACCOR 1,25%17-250124	25/01/2017	25/01/2024	EUR	12	1,25	1.194.050,88	0,66
FR0013245263 SPIE 3,125%17-220324	22/03/2017	22/03/2024	EUR	20	3,125	2.073.979,18	1,15

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% Patrimonio neto
FR0013248713 NEXANS 2,75%17-050424	05/04/2017	05/04/2024	EUR	18	2,75	1.852.238,96	1,03
FR0013251329 BEL 1,5%17-180424	18/04/2017	18/04/2024	EUR	5	1,50	517.626,51	0,29
FR0013281946 INGENICO GROUP 1,625%17-130924	13/09/2017	13/09/2024	EUR	20	1,625	2.060.091,78	1,14
FR0013284643 ERAMET 4,196%17-280224	28/09/2017	28/02/2024	EUR	26	4,196	2.049.470,60	1,13
FR0013287273 ILIAD 1,5%17-141024	12/10/2017	14/10/2024	EUR	20	1,50	2.008.056,39	1,11
FR0013329315 RENAULT 1%18-180424	18/04/2018	18/04/2024	EUR	20	1,00	1.907.190,68	1,06
FR0013413556 ELIS 1,75%19-110424	11/04/2019	11/04/2024	EUR	15	1,75	1.493.598,70	0,83
FR0013477254 AIR FRANCE - KLM 1,875%20-0125	16/01/2020	16/01/2025	EUR	17	1,875	1.273.894,44	0,71
FR0013478849 QUADIENT 2,25%20-030225	23/01/2020	03/02/2025	EUR	12	2,25	1.180.314,16	0,65
XS1490137418 CROWN EURO.HOLDING 2,625%16-24	15/09/2016	30/09/2024	EUR	1.700	2,625	1.745.433,92	0,97
XS1512670412 MOBILUX FIN 5,5%16-151124	10/11/2016	15/11/2024	EUR	900	5,50	927.810,50	0,51
XS1577949149 3AB OPTIQ.DEVELOPMT 4%17-1023	17/10/2017	01/10/2023	EUR	800	4,00	779.888,89	0,43
XS1600514696 BURGER KING FR 6%17-010524	21/04/2017	01/05/2024	EUR	700	6,00	706.801,67	0,39
XS1605600532 LA FIN. ATALIAN 4%17-150524	05/05/2017	15/05/2024	EUR	600	4,00	519.001,33	0,29
XS1703065620 CMA CGM 5,25%17-150125	24/10/2017	15/01/2025	EUR	1.000	5,25	916.614,17	0,51
XS1794209459 PAPREC HOLDING 4%18-310325	29/03/2018	31/03/2025	EUR	1.000	4,00	964.024,44	0,53
XS1987729412 FNAC DARTY 1,875%19-300524	14/05/2019	30/05/2024	EUR	1.500	1,875	1.508.556,25	0,84
XS2010039118 QUATRIM 5,875%19-150124	20/11/2019	15/01/2024	EUR	1.800	5,875	1.769.935,75	0,98
XS2031870921 LOXAM 3,25%19-140125	22/07/2019	14/01/2025	EUR	2.500	3,25	2.386.136,81	1,32
XS2054539627 ALTICE FRANCE 2,5%19-150125	27/09/2019	15/01/2025	EUR	3.000	2,50	2.905.671,67	1,61
XS2112340679 BANIJAY ENTERT 3,5%20-010325	11/02/2020	01/03/2025	EUR	1.500	3,50	1.471.955,83	0,82
TOTAL REINO UNIDO						6.886.882,97	3,81
XS1600824962 NOMAD FOODS 3,25%17-150524	03/05/2017	15/05/2024	EUR	1.000	3,25	1.027.108,89	0,57
XS1819575066 ROLLS-ROYCE 0,875%18-090524	09/05/2018	09/05/2024	EUR	1.500	0,875	1.316.685,00	0,73
XS1844997970 INTER GAME TECH 3,5%18-150724	27/06/2018	15/07/2024	EUR	2.500	3,50	2.497.490,28	1,38
XS2010037849 JAGUAR LAND 5,875%19-151124	26/11/2019	15/11/2024	EUR	2.200	5,875	2.045.598,80	1,13
TOTAL ISLA DE MAN						1.730.852,17	0,96
XS1849464323 PLAYTECH 3,75%18-121023	12/10/2018	12/10/2023	EUR	1.700	3,75	1.730.852,17	0,96
TOTAL IRLANDA						4.304.588,99	2,38
XS1117298759 SMURFIT KAP ACQ 2,75%15-0225	16/02/2015	01/02/2025	EUR	2.000	2,75	2.124.139,44	1,17
XS2003442436 AIB GROUP 1,25%19-24	28/05/2019	28/05/2024	EUR	500	1,25	510.669,66	0,28

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% Patrimonio neto
XS2023633931 BK OF IE GRP 0,75%19-080724	08/07/2019	08/07/2024	EUR	500		501.003,56	0,28
XS2063288943 EIRCOM FINANCE 1,75%19-011124	22/10/2019	01/11/2024	EUR	1.200	1,75	1.168.776,33	0,65
TOTAL ITALIA						20.151.208,46	11,16
IT0005108490 AUTOSTRADE 1,625%15-120623	12/06/2015	12/06/2023	EUR	1.000	1,625	975.926,30	0,54
XS0215093534 LEONARDO 4,875%05-25	08/03/2005	24/03/2025	EUR	2.500	4,875	2.861.434,59	1,58
XS1206977495 UNIPOL GRUPPO 3%15-180325 SR.3	18/03/2015	18/03/2025	EUR	2.500	3,00	2.661.709,93	1,47
XS1454980159 SISAL GROUP 7%16-310723	28/07/2016	31/07/2023	EUR	300	7,00	210.870,11	0,12
XS1707063589 WEBUILD 1,75%17-261024	26/10/2017	26/10/2024	EUR	2.800	1,75	2.473.246,89	1,37
XS1757843146 PIRELLI AND C. 1,375%18-250123	25/01/2018	25/01/2023	EUR	1.000	1,375	1.006.239,64	0,56
XS1935256369 TELECOM ITALIA 4%19-110424	11/01/2019	11/04/2024	EUR	3.500	4,00	3.788.394,73	2,11
XS2015314037 UBI BANCA 2,625%19-200624	20/06/2019	20/06/2024	EUR	2.000	2,625	2.117.438,90	1,17
XS2016160777 BANCO BPM 2,5%19-210624	21/06/2019	21/06/2024	EUR	2.000	2,50	2.064.089,59	1,14
XS2066703989 NEXI 1,75%19-311024	21/10/2019	31/10/2024	EUR	2.000	1,75	1.991.857,78	1,10
TOTAL JERSEY						1.830.613,14	1,01
XS1468662801 ADIENT GLB HLDG 3,5%16-150824	19/08/2016	15/08/2024	EUR	1.000	3,50	929.325,22	0,51
XS1496337236 AVIS BUDGET 4,125%16-151124	26/09/2016	15/11/2024	EUR	1.000	4,125	901.287,92	0,50
TOTAL JAPÓN						3.165.300,00	1,75
XS1811213781 SOFTBANK GROUP 4%18-200423	20/04/2018	20/04/2023	EUR	3.000	4,00	3.165.300,00	1,75
TOTAL LUXEMBURGO						11.540.842,38	6,39
XS1405769990 INEOS FIN 5,375%16-010824	09/08/2016	01/08/2024	EUR	600	5,375	606.784,58	0,34
XS1409497283 GESTAMP FDG 3,5%16-150523	11/05/2016	15/05/2023	EUR	700	3,50	683.367,61	0,38
XS1419661118 HANESBRANDS FIN.3,5%16-150624	03/06/2016	15/06/2024	EUR	2.250	3,50	2.370.178,75	1,31
XS1651444140 EUROFINS SCIENTIFI 2,125%17-24	25/07/2017	25/07/2024	EUR	2.500	2,125	2.637.892,81	1,46
XS1936308391 ARCELORMITTAL 2,25%19-170124	17/01/2019	17/01/2024	EUR	1.800	2,25	1.862.463,84	1,03
XS1974797364 LINCOLN FIN 3,625%19-010424	02/04/2019	01/04/2024	EUR	1.500	3,625	1.445.341,04	0,80
XS2052286676 MATTERHORN TEL 2,625%19-150924	19/09/2019	15/09/2024	EUR	1.000	2,625	979.289,58	0,54
XS2110768525 STENA INTL 3,75%20-010225	31/01/2020	01/02/2025	EUR	1.000	3,75	955.524,17	0,53
TOTAL MÉXICO						5.618.494,83	3,11
XS1533916299 NEMAK 3,25%17-150324	14/03/2017	15/03/2024	EUR	2.000	3,25	1.965.629,44	1,08
XS1568874983 PEMEX 3,75%17-210224	21/02/2017	21/02/2024	EUR	2.000	3,75	1.944.641,64	1,08
XS1731106347 CEMEX 2,75%17-051224	05/12/2017	05/12/2024	EUR	1.700	2,75	1.708.223,75	0,95

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% Patrimonio neto
TOTAL PAÍSES BAJOS						22.658.253,15	12,55
XS0982711714 PETROBRAS GLOB 4,75%14-140125	14/01/2014	14/01/2025	EUR	2.500	4,75	2.865.331,83	1,59
XS1388625425 FIAT CHRYSLER A 3,75%16-290324	30/03/2016	29/03/2024	EUR	1.700	3,75	1.833.470,96	1,02
XS1405765907 OI EUROP GRP 3,125%16-151124	03/11/2016	15/11/2024	EUR	1.500	3,125	1.538.943,54	0,85
XS1439749281 TEVA PHARMAC 1,125%16-151024	25/07/2016	15/10/2024	EUR	3.500	1,125	3.078.286,43	1,70
XS1492656787 AXALTA CSDH B 3,75%16-150125	27/09/2016	15/01/2025	EUR	1.500	3,75	1.523.086,25	0,84
XS1647815775 UNITED GROUP 4,875%17-010724	27/07/2017	01/07/2024	EUR	1.000	4,875	1.024.217,08	0,57
XS1699848914 DUFY ONE 2,5%17-151024	24/10/2017	15/10/2024	EUR	2.500	2,50	2.204.618,06	1,22
XS1711584430 SAIPEM FIN INT 2,625%17-070125	07/11/2017	07/01/2025	EUR	4.000	2,625	4.009.652,13	2,23
XS2010040124 ZF EU FINANCE 1,25%19-231023	23/10/2019	23/10/2023	EUR	10	1,25	964.432,79	0,53
XS2066213625 OCI 3,125%19-011124	18/10/2019	01/11/2024	EUR	1.700	3,125	1.718.508,98	0,95
XS2115189875 Q-PARK HLDG 1,5%20-010325	13/02/2020	01/03/2025	EUR	1.500	1,50	1.376.012,50	0,76
XS2176872849 PPF Telecom Grp 3,5% 200524	20/05/2020	20/05/2024	EUR	500	3,50	521.692,60	0,29
TOTAL SUECIA						4.639.609,73	2,57
XS1634532748 INTRUM 3,125%17-150724 REGS	26/06/2017	15/07/2024	EUR	3.500	3,125	3.337.789,09	1,85
XS1724626699 VOLVO CAR 2%17-240125 EMTN	24/11/2017	24/01/2025	EUR	1.300	2,00	1.301.820,64	0,72
TOTAL ESTADOS UNIDOS DE AMÉRICA						11.482.432,75	6,36
XS1405782407 KRAFT HEINZ FDS 1,5%16-240524	25/05/2016	24/05/2024	EUR	500	1,50	505.731,78	0,28
XS1523028436 MPT 3,325%17-240325	24/03/2017	24/03/2025	EUR	1.500	3,325	1.597.215,62	0,88
XS1533922776 QUINTILES IMS 3,25%17-150325	28/02/2017	15/03/2025	EUR	2.500	3,25	2.525.886,81	1,40
XS1687277985 AVANT INC 4,75%17-011024	02/10/2017	01/10/2024	EUR	2.000	4,75	2.074.403,89	1,15
XS1801786275 COTY 4%18-150423	05/04/2018	15/04/2023	EUR	1.900	4,00	1.636.860,55	0,91
XS1959498160 FORD MOTOR CRED 3,021%19-0324	06/03/2019	06/03/2024	EUR	1.500	3,021	1.500.241,64	0,83
XS2093880735 BERRY GLOBAL 1%20-150125	02/01/2020	15/01/2025	EUR	1.700	1,00	1.642.092,46	0,91
TOTAL Bonos de tipo de variable revisable negociados en un mercado regulado o similar						1.267.452,33	0,70
TOTAL FRANCIA						1.267.452,33	0,70
XS1733942178 PICARD GROUPE TV17-301123	14/12/2017	30/11/2023	EUR	1.300		1.267.452,33	0,70
TOTAL Bonos convertibles negociados en un mercado regulado o similar						1.369.556,00	0,76
TOTAL FRANCIA						1.369.556,00	0,76
FR0012658094 URW 0%15-0122 ORNANE	15/04/2015	01/01/2022	EUR	4.000		1.369.556,00	0,76
Total Valores subordinados (TSR - TSDI)						4.838.898,77	2,68

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% Patrimonio neto
TOTAL ALEMANIA						2.065.442,29	1,14
DE000DB7XJJ2 DEUTSCHE BANK 2,75%15-170225	17/02/2015	17/02/2025	EUR	2.000	2,75	2.065.442,29	1,14
TOTAL FRANCIA						1.083.739,18	0,60
FR0012304459 CRED.AGRICOLE 3%14-221224 TSR	22/12/2014	22/12/2024	EUR	1.000.000	3,00	1.083.739,18	0,60
TOTAL ITALIA						1.689.717,30	0,94
IT0004917842 MEDIOBANCA 5,75%13-180423	18/04/2013	18/04/2023	EUR	1.500	5,75	1.689.717,30	0,94
TOTAL Títulos de OIC						16.190.492,00	8,97
TOTAL OICVM y equivalentes de otros Estados miembros de la UE						16.190.492,00	8,97
TOTAL FRANCIA						16.190.492,00	8,97
FR0000009987 UNION + (IC)			EUR	11		2.086.805,60	1,16
FR0012698173 CM-CIC HIGH YIELD (IC)			EUR	128		14.103.686,40	7,81

REGLAMENTO SFTR

Este OIC no ha participado en operaciones sujetas al Reglamento UE 2015/2365 sobre transparencia de las operaciones de financiación de valores y de reutilización («Reglamento SFTR») durante el periodo y, por consiguiente, no tiene ninguna información que comunicar a los inversores al respecto.