

CM-CIC OBLI 7-10

DOCUMENTO DE INFORMACIÓN SEMESTRAL A 30/6/2020

FORMA JURÍDICA DEL OIC

Fondo de inversión colectiva general

CLASIFICACIÓN

Clasificación del BCE Fondo de renta fija

ASIGNACIÓN DE RESULTADOS

Resultado capitalizable

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	108.780.439,37
b) Activos bancarios	2.838.947,14
c) Otros activos mantenidos por el OICVM	9.765.322,70
d) Total de activos mantenidos por el OICVM	121.384.709,21
e) Pasivo	-62.393,54
f) Valor de inventario neto	121.322.315,67

* Los importes están firmados

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
A1 CIC OBLI 7 10ER 6D	Capitalizable	7.258.296,95	68.028,83336	106,69
C1 CM CIC OBLI 7-10	Capitalizable	114.064.018,72	22.415,00	5.088,73

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	89,66	89,62
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	8,05	8,04

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 activos
SPANIEN 18-28	EUR	11.723.523,89	9,70	9,68
KRED WIED 0,625%27	EUR	11.268.568,72	9,29	9,28
OAT0,50%19-29	EUR	7.474.953,85	6,16	6,16
SPAIN 1,5%300427	EUR	7.034.489,86	5,80	5,80
OAT2,75%12-27	EUR	6.131.709,52	5,05	5,05
ALLEMAGNE 0%150230	EUR	5.249.950,00	4,33	4,33
ITALY 4,75%010944	EUR	5.111.887,76	4,21	4,21
PORTUGAL 18-28	EUR	4.081.026,49	3,36	3,36
ITALIE 2,05%27 BTP	EUR	3.777.236,40	3,11	3,11
AUSTRIA 0,5%200427	EUR	3.727.045,00	3,07	3,07
RATP 0,875%250527	EUR	3.199.682,87	2,64	2,64
ESPAÑA 0,6%311029	EUR	3.082.189,18	2,54	2,54
BELGIUM 0,8%220628	EUR	2.721.022,95	2,24	2,24
ITALY 2%010228	EUR	2.474.941,68	2,04	2,04
NETHERLAND 0,75%27	EUR	2.409.909,93	1,99	1,99
OAT0,50%16-26	EUR	2.329.427,21	1,92	1,92
DEXIA CLF 1%181027	EUR	2.166.838,36	1,79	1,79
CDP 1,875%070226	EUR	2.102.599,00	1,73	1,73
KRED WIEDERA 0%26	EUR	2.056.280,00	1,69	1,69
DT. BAHN FIN. 18/2	EUR	1.923.785,70	1,59	1,58
AG.F.DEV.0,25%26	EUR	1.542.825,33	1,27	1,27
GERMANY 2,5%040744	EUR	1.499.097,05	1,24	1,24
HSBC 0,1%030927	EUR	1.262.713,23	1,04	1,04
ALLEMAGNE TV26 INF	EUR	1.130.324,20	0,93	0,93
NORTH RHIN 0,95%28	EUR	1.097.669,04	0,90	0,90
OAT0,25%16-26	EUR	940.817,46	0,78	0,78
ITALY 3,45%010348	EUR	885.626,91	0,73	0,73
TELENOR 0,25%27	EUR	801.559,52	0,66	0,66
PROLOGIS 0,25%27	EUR	756.757,43	0,62	0,62
BOUYGUES 1,125%28	EUR	729.951,79	0,60	0,60
ALLIANZ 0,5%0131	EUR	708.856,68	0,58	0,58
BANQUE PO 0,25%26	EUR	697.579,19	0,57	0,57
OAT 2%17-48	EUR	694.931,10	0,57	0,57
OATE0,25%13-24 IND	EUR	560.781,78	0,46	0,46
JPMORGAN CHAS TV28	EUR	537.301,09	0,44	0,44
DH EUROPE 0,2%26	EUR	522.426,74	0,43	0,43
BPCE 0,625%150130	EUR	509.827,96	0,42	0,42
THALES 0,25%290127	EUR	495.449,37	0,41	0,41
SCHLUMBER 0,25%27	EUR	474.195,98	0,39	0,39
KONINKLIJKE P.30	EUR	336.363,21	0,28	0,28
GRENKE F 0,625%25	EUR	333.584,44	0,27	0,27
NESTLE F 1,125%26	EUR	318.313,68	0,26	0,26
ORAFP 1,125% 0727	EUR	316.691,15	0,26	0,26
SCHNEIDER EL 1%27	EUR	316.335,41	0,26	0,26
SANOFI 1%25 EMTN	EUR	314.281,56	0,26	0,26

Valores	Divisa	En importe (EUR)	Porcentaje	
			Patrimonio neto	Total activos
KERING 0,75%130528	EUR	306.533,22	0,25	0,25
AIR LIQUIDE FI0430	EUR	219.737,62	0,18	0,18
BELGIQUE 1%220626	EUR	217.162,79	0,18	0,18
SPAIN 2,7%311048	EUR	205.676,07	0,17	0,17
TOTAL	EUR	108.780.439,37	89,66	89,62
TOTAL		108.780.439,37	89,66	89,62

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
Soberanos	60,59	60,55
Entidades garantizadas por el Estado	12,25	12,25
Bancos	5,41	5,41
Entidad no garantizada por el Estado	4,22	4,22
Administraciones territoriales	0,90	0,90
Servicios financieros	0,83	0,83
Otros sectores económicos	5,46	5,46
TOTAL	89,66	89,62

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	24,91	24,90
ALEMANIA	19,97	19,96
ESPAÑA	18,17	18,16
OTROS PAÍSES	26,61	26,60
TOTAL	89,66	89,62

DESGLOSE DE OTROS ACTIVOS POR TIPO

Tipo de activo	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
PARTICIPACIONES DE OIC	8,05	8,04
▪ OIC y Fondos de inversión de tipo general (no profesionales)	8,05	8,04
▪ 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	8,05	8,04

MOVIMIENTOS EN LA CARTERA DE VALORES DURANTE EL PERIODO

Movimientos registrados durante el periodo	Movimientos (en importe)
Adquisiciones	29.066.674,09
Cesiones	27.193.335,20

DETALLE DE LA CARTERA DE VALORES

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% del Patrimonio neto
TOTAL Bonos y valores similares						57.530.355,70	47,42
TOTAL Bonos y valores similares negociados en un mercado regulado o similar						57.034.906,33	47,01
TOTAL Bonos de tipo de fijo negociados en un mercado regulado o similar						56.474.124,55	46,55
TOTAL ALEMANIA						16.346.303,46	13,47
DE000A2DAR65 KRED WIEDERAUFBAU 0,625%17-27	21/2/2017	22/2/2027	EUR	10.500	0,625	11.268.568,72	9,29
DE000A2TSTU4 KRED WIEDERAUFBAU 0%19-300723	24/9/2019	30/9/2026	EUR	2.000		2.056.280,00	1,69
DE000NRW0K03 NORTH RHINE-W 0,95%18-130528	13/3/2018	13/3/2028	EUR	1.000	0,95	1.097.669,04	0,90
XS1752475720 DEUTSCHBAHNFIN 1%18-171227	18/1/2018	17/12/2027	EUR	1.800	1,00	1.923.785,70	1,59
TOTAL FRANCIA						29.154.836,83	24,05
FR0011317783 OAT 2,75%12-25102027	11/9/2012	25/10/2027	EUR	4.900.000	2,75	6.131.709,52	5,05
FR0013131877 OAT 0,50%16-25052026	3/3/2016	25/5/2026	EUR	2.200.000	0,50	2.329.427,21	1,92
FR0013190188 AGENCE FR.DEV.0,25%16-21072026	21/7/2016	21/7/2026	EUR	15	0,25	1.542.825,33	1,27
FR0013200813 OAT 0,25%16-25112026	5/9/2016	25/11/2026	EUR	900.000	0,25	940.817,46	0,78
FR0013257524 OAT 2%17-25052048	25/5/2017	25/5/2048	EUR	500.000	2,00	694.931,10	0,57
FR0013264488 RATP 0,875%17-250527	29/6/2017	25/5/2027	EUR	30	0,875	3.199.682,87	2,64
FR0013407236 OAT 0,50%19-25052029	11/3/2019	25/5/2029	EUR	7.000.000	0,50	7.474.953,85	6,19
FR0013433596 BANQUE POSTALE 0,25%19-120726	12/7/2019	12/7/2026	EUR	7	0,25	697.579,19	0,57
FR0013444304 HSBC 0,1%19-030927	3/9/2019	3/9/2027	EUR	13	0,10	1.262.713,23	1,04
FR0013476207 BPCE 0,625%20-150130	15/1/2020	15/1/2030	EUR	5	0,625	509.827,96	0,42
FR0013505104 SANOFI 1%20-010425 EMTN	30/3/2020	1/4/2025	EUR	3	1,00	314.281,56	0,26
FR0013505567 AIR LIQUIDE FINANCE 020430	2/4/2020	2/4/2030	EUR	2	1,375	219.737,62	0,18
FR0013506292 ORAFP 1,125% 0727	31/3/2020	7/7/2027	EUR	3	1,25	316.691,15	0,26
FR0013506862 SCHNEIDER EL 1%20-090427	9/4/2020	9/4/2027	EUR	3	1,00	316.335,41	0,26
FR0013507654 BOUYGUES 1,125%21-240728	24/7/2021	24/7/2028	EUR	7	1,125	729.951,79	0,60
FR0013512407 KERING 0,75%20-130528	13/5/2020	13/5/2028	EUR	3	0,75	306.533,22	0,25
XS1700578724 DEXIA CLF 1%17-181027	18/10/2017	18/10/2027	EUR	40	1,00	2.166.838,36	1,79

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% del Patrimonio neto
TOTAL IRLANDA						333.584,44	0,27
XS2078696866 GRENKE FINANCE 0,625%19-090125	12/11/2019	9/1/2025	EUR	350	0,625	333.584,44	0,27
TOTAL ITALIA						2.102.599,00	1,73
IT0005323438 CDP 1,875%18-070226	31/1/2018	7/2/2026	EUR	20	1,875	2.102.599,00	1,73
TOTAL LUXEMBURGO						840.740,42	0,69
XS2050404636 DH EUROPE FIN II 0,2%19-180326	18/9/2019	18/3/2026	EUR	530	0,20	522.426,74	0,43
XS2148372696 NESTLE FIN 1,125%20-010426	1/4/2020	1/4/2026	EUR	300	1,125	318.313,68	0,26
TOTAL PAÍSES BAJOS						1.519.415,87	1,25
DE000A28RSR6 ALLIANZ FINANCE II 0,5%20-0131	14/1/2020	14/1/2031	EUR	7	0,50	708.856,68	0,58
XS2010045198 SCHLUMBERG FINANCE BV 0,25% 151027	13/9/2019	15/10/2027	EUR	500	0,25	474.195,98	0,39
XS2149379211 KONINKLIJKE PHILIPS 30032030	30/3/2020	30/3/2030	EUR	300	2,00	336.363,21	0,28
TOTAL NORUEGA						801.559,52	0,66
XS2056396919 TELENOR 0,25%19-250927	25/9/2019	25/9/2027	EUR	800	0,25	801.559,52	0,66
TOTAL PORTUGAL						4.081.026,49	3,36
PTOTEVOE0018 PORTUGAL 2,125%18-171028	17/1/2018	17/10/2028	EUR	350.000.000	2,125	4.081.026,49	3,36
TOTAL ESTADOS UNIDOS DE AMÉRICA						1.294.058,52	1,07
XS2049582625 PROLOGIS 0,25%19-100927	10/9/2019	10/9/2027	EUR	770	0,25	756.757,43	0,63
XS2123320033 JPMORGAN CHASE TV20-240228	24/2/2020	24/2/2028	EUR	550		537.301,09	0,44
TOTAL Bonos indexados negociados en un mercado regulado o similar						560.781,78	0,46
TOTAL FRANCIA						560.781,78	0,46
FR0011427848 OATE 0,25%13-25072024 INDX	26/2/2013	25/7/2024	EUR	500.000	0,25	560.781,78	0,46
TOTAL Bonos y valores similares no negociados en un mercado regulado o similar						495.449,37	0,41
TOTAL Bonos y valores similares no negociados en un mercado regulado o similar						495.449,37	0,41
TOTAL FRANCIA						495.449,37	0,41
FR0013479748 THALES 0,25%20-290127	29/1/2020	29/1/2027	EUR	5	0,25	495.449,37	0,41
TOTAL Títulos de crédito						51.250.083,67	42,24
TOTAL Títulos de crédito negociados en un mercado regulado o similar						51.250.083,67	42,24
TOTAL Títulos de crédito negociables						51.250.083,67	42,24
TOTAL AUSTRIA						3.727.045,00	3,07
AT0000A1VGK0 AUSTRIA 0,5%17-200427	11/4/2017	20/4/2027	EUR	3.500	0,50	3.727.045,00	3,07

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% del Patrimonio neto
TOTAL BÉLGICA						2.938.185,74	2,42
BE0000337460 BELGIQUE 1%16-220626	13/1/2016	22/6/2026	EUR	20.000.000	1,00	217.162,79	0,18
BE0000345547 BELGIUM 0,8%18-220628	23/1/2018	22/6/2028	EUR	250.000.000	0,80	2.721.022,95	2,24
TOTAL ALEMANIA						7.879.371,25	6,49
DE0001030567 ALLEMAGNE TV15-150426 INFLAT.	12/3/2015	15/4/2026	EUR	100.000.000	0,10	1.130.324,20	0,93
DE0001102499 ALLEMAGNE 0%20-150230	10/1/2020	15/2/2030	EUR	500.000.000		5.249.950,00	4,32
DE0001135481 GERMANY 2,5%12-040744	27/4/2012	4/7/2044	EUR	90.000.000	2,50	1.499.097,05	1,24
TOTAL ESPAÑA						22.045.879,00	18,17
ES00000128P8 SPAIN 1,5%17-300427	31/1/2017	30/4/2027	EUR	6.400	1,50	7.034.489,86	5,80
ES0000012B39 SPAIN 1,4%18-300428	30/1/2018	30/4/2028	EUR	10.700	1,40	11.723.523,89	9,66
ES0000012B47 SPAIN 2,7%18-311048	27/2/2018	31/10/2048	EUR	150	2,70	205.676,07	0,17
ES0000012F43 ESPAGNE 0,6%19-311029	12/6/2019	31/10/2029	EUR	3.000	0,60	3.082.189,18	2,54
TOTAL ITALIA						12.249.692,75	10,10
IT0004923998 ITALY 4,75%13-010944	22/5/2013	1/9/2044	EUR	3.400	4,75	5.111.887,76	4,22
IT0005273013 ITALY 3,45%17-010348	7/6/2017	1/3/2048	EUR	700	3,45	885.626,91	0,73
IT0005274805 ITALIE 2,05%17-010827 BTP	30/6/2017	1/8/2027	EUR	3.500	2,05	3.777.236,40	3,11
IT0005323032 ITALY 2%18-010228	30/1/2018	1/2/2028	EUR	2.300	2,00	2.474.941,68	2,04
TOTAL PAÍSES BAJOS						2.409.909,93	1,99
NL0012171458 NETHERLANDS 0,75%17-150727	9/2/2017	15/7/2027	EUR	2.200.000	0,75	2.409.909,93	1,99
TOTAL Títulos de OIC						9.765.322,70	8,05
TOTAL OICVM y equivalentes de otros Estados miembros de la UE						9.765.322,70	8,05
TOTAL FRANCIA						9.765.322,70	8,05
FR0011067107 UNION OBLI 2020 (D)			EUR	1		115,25	0,00
FR0011153378 CM-CIC INFLATION (C)			EUR	66.076,576		7.224.812,82	5,96
FR0013246550 CM-CIC GREEN BONDS IC SI.3DEC			EUR	15		1.507.388,70	1,24
FR0013380748 CM-CIC OBLI LONG TERME I FCP			EUR	1		1.033.005,93	0,85

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.