

CM-CIC OBLIGATIONS

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 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	135.234.516,05
b) Activos bancarios	956.489,24
c) Otros activos mantenidos por el OICVM	7.328.236,63
d) Total de activos mantenidos por el OICVM	143.519.241,92
e) Pasivo	-136.103,49
f) Valor de inventario neto	143.383.138,43

* 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 CM-CIC OBL.ER 6D	Capitalizable	9.467.175,55	94.397,57017	100,29
C1 CM-CIC OBLIG.C 3D	Capitalizable	62.331.965,82	1.072.047,273	58,14
D1 CM-CIC OBLIG.D 3D	De reparto	71.583.997,06	2.690.319,584	26,60

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	94,32	94,23
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	5,07	5,06

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
CDP 2,75%310521	EUR	7.192.226,71	5,05	5,00
SPAIN 0,35%300723	EUR	6.242.570,66	4,35	4,35
KRED WIED 0,125%20	EUR	5.865.864,08	4,09	4,09
NORTH RHINE-W 1%25	EUR	5.338.050,82	3,72	3,72
ESPANA 3,8%300424	EUR	4.650.955,62	3,24	3,24
ITALY 4,75%010944	EUR	4.510.489,20	3,15	3,14
OATE0,25%13-24 IND	EUR	4.486.254,20	3,13	3,13
ALLEMAGNE 0,25%29	EUR	4.188.454,23	2,92	2,92
C.LYONNAIS 4,0%26	EUR	3.474.802,09	2,42	2,42
EUROFIMA 1/4%0423	EUR	3.461.219,56	2,41	2,41
VATTENFAL 0,05%25	EUR	3.270.837,92	2,28	2,28
LBP 4,375%10-8%1120	EUR	3.127.920,41	2,18	2,18
CORES 1,5%271122	EUR	2.936.540,39	2,05	2,05
ITALY 2,45%011023	EUR	2.685.721,25	1,87	1,87
PORTUGAL 4,75%010823	EUR	2.424.333,44	1,69	1,69
CDP 0,75%211122	EUR	2.328.083,46	1,62	1,62
FADE 0,05%170924	EUR	2.314.160,21	1,61	1,61
INGENICO 2,5%0521	EUR	2.136.256,93	1,49	1,49
BFCM 0,125%050224	EUR	2.097.827,47	1,46	1,46
LANDW RENT 0,25%24	EUR	2.060.182,40	1,44	1,44
NORTH RHI 0,375%280223	EUR	2.044.347,38	1,43	1,42
BPIFRANCE 0,125%23	EUR	2.032.182,73	1,42	1,42
BK OF NOVA 0,5%24	EUR	2.005.726,03	1,40	1,40
DEUTSCHE 0,375%21	EUR	1.998.081,64	1,39	1,39
PROSEGUR 1%080223	EUR	1.906.102,32	1,33	1,33
WELLS FARGO 0,5%24	EUR	1.789.250,05	1,25	1,25
PROVINCE 0,625%25	EUR	1.748.236,22	1,22	1,22
CH.DIOR 0,75%21	EUR	1.706.756,45	1,19	1,19
CO.RABOBK 4 1/8%22	EUR	1.676.744,75	1,17	1,17
TORONTO 0,375%24	EUR	1.606.765,81	1,12	1,12
FED CAISS 0,25%21	EUR	1.600.474,78	1,12	1,12
BFCM 4%10-2020	EUR	1.558.229,34	1,09	1,09
FERRARI 1,5%160323	EUR	1.556.787,53	1,09	1,08
NORDEA BANK 4%21	EUR	1.551.226,44	1,08	1,08
THALES 2,125%0921	EUR	1.550.521,52	1,08	1,08
FADE 0,5%170323	EUR	1.530.443,63	1,07	1,07
VOLKSWAGEN 0,75%20	EUR	1.510.800,49	1,05	1,05
MIZUHO F 0,523%24	EUR	1.496.332,85	1,04	1,04
BANCO SAN 0,25%21	EUR	1.397.996,66	0,98	0,97
DEXIA CLF 0,5%24	EUR	1.343.187,85	0,94	0,94
HAVAS 1,875%1220	EUR	1.316.288,36	0,92	0,92
SOCIETE G 0,25%21	EUR	1.305.530,04	0,91	0,91
MERCK FI 0,05%23	EUR	1.196.468,79	0,83	0,83
OMV 0%0622	EUR	1.184.652,00	0,83	0,83
ITALIE 5,5%011122	EUR	1.132.616,30	0,79	0,79

Valores	Divisa	En importe (EUR)	Porcentaje	
			Patrimonio neto	Total activos
ING 0,375%261121	EUR	1.107.506,24	0,77	0,77
ABN AMRO 0,25%21	EUR	1.105.640,90	0,77	0,77
DASSAULT SYS 0%24	EUR	1.095.226,00	0,76	0,76
GOLDM.S.GRP_14/21	EUR	1.048.262,95	0,73	0,73
CO.RABOBK 3,75%20	EUR	1.036.490,33	0,72	0,72
URW 0%15 ORN.	EUR	1.016.706,00	0,71	0,71
WESTPAC SEC 0,3%24	EUR	1.007.027,53	0,70	0,70
SAP 0,25%100322	EUR	1.006.240,82	0,70	0,70
HSBC 0,2%21 EMTN	EUR	1.004.750,27	0,70	0,70
BASF 0,101%050623	EUR	1.002.174,71	0,70	0,70
DEUTSCHE BAHN 0%21	EUR	1.001.150,00	0,70	0,70
SAFRAN 25%21	EUR	999.612,67	0,70	0,70
VW INTL FIN 0,5%21	EUR	996.283,57	0,69	0,69
DAIMLER IN 0,25%22	EUR	996.156,16	0,69	0,69
SCHLUMBERGER 0%24	EUR	977.890,00	0,68	0,68
ASAHI GRO 0,321%21	EUR	799.141,70	0,56	0,56
SIEMENS FIN 0%26	EUR	794.064,00	0,55	0,55
VOLKSWAGEN 0,5%22	EUR	792.043,51	0,55	0,55
CONTINENTAL 0%23	EUR	714.560,50	0,50	0,50
ADIDAS 1,25%081021	EUR	712.980,10	0,50	0,50
MAHLE GMBH 2,5%21	EUR	571.747,72	0,40	0,40
PERNOD RICARD 0%23	EUR	495.985,00	0,35	0,35
EUROCLEAR 0,5%23	EUR	407.672,28	0,28	0,28
ECONOCOM GROUP	EUR	6.702,08	0,00	0,00
TOTAL	EUR	135.234.516,05	94,32	94,23
TOTAL		135.234.516,05	94,32	94,23

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
Bancos	29,61	29,57
Soberanos	21,15	21,13
Entidades garantizadas por el Estado	11,67	11,66
Administraciones territoriales	5,15	5,14
Automóviles y piezas de repuesto	3,59	3,59
Supranacional	2,41	2,41
Otros sectores económicos	20,74	20,73
TOTAL	94,32	94,23

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	21,45	21,41
ALEMANIA	20,93	20,91
ESPAÑA	14,63	14,62
OTROS PAÍSES	37,31	37,29
TOTAL	94,32	94,23

DESGLOSE DE OTROS ACTIVOS POR TIPO

Tipo de activo	Porcentaje	
	Patrimonio neto	Total de activos
PARTICIPACIONES DE OIC	5,07	5,06
▪ OIC y Fondos de inversión de tipo general (no profesionales)	5,07	5,06
▪ 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	5,07	5,06

MOVIMIENTOS EN LA CARTERA DE VALORES DURANTE EL PERIODO

Movimientos registrados durante el periodo	Movimientos (en importe)
Adquisiciones	10.417.054,89
Cesiones	12.815.444,74

REPARTO DURANTE EL PERIODO EN CURSO

		Importe unitario en EUR			
	Participación	Porcentaje del resultado	Porcentaje de las plusvalías netas	Total unitario	Crédito de impuestos
Dividendos pagados					
27/2/2020	D PART DIST D	0,00	0,00	0,00	0,00
	D1 PART DIST D	0,08	0,00	0,08	0,00
Dividendos por pagar					
	D PART DIST D	0,00	0,00	0,00	0,00
	D1 PART DIST D	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	% del Patrimonio neto
TOTAL Acciones y valores similares						6.702,08	0,00
TOTAL Acciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar						6.702,08	0,00
TOTAL Acciones y valores similares negociados en un mercado regulado o similar (salvo warrants y bonos de sus.)						6.702,08	0,00
TOTAL BÉLGICA						6.702,08	0,00
BE0974313455 ECONOCOM GROUP			EUR	3.584		6.702,08	0,00
TOTAL Bonos y valores similares						109.392.673,27	76,30
TOTAL Bonos y valores similares negociados en un mercado regulado o similar						109.392.673,27	76,30
TOTAL Bonos de tipo de fijo negociados en un mercado regulado o similar						93.939.489,13	65,52
TOTAL AUSTRIA						1.184.652,00	0,83
XS2022093434 OMV 0%19-75%0325	3/7/2019	3/7/2025	EUR	1.200		1.184.652,00	0,83
TOTAL BÉLGICA						407.672,28	0,28
BE6305977074 EUROCLEAR BANK 0,5%18-100723	10/7/2018	10/7/2023	EUR	400	0,50	407.672,28	0,28
TOTAL CANADÁ						6.961.202,84	4,85
XS1808478710 PROVINCE OF ALBERT 0,625%18-25	18/4/2018	18/4/2025	EUR	1.700	0,625	1.748.236,22	1,22
XS1885605391 FED CAISS DESJARD 0,25%18-0921	27/9/2018	27/9/2021	EUR	1.600	0,25	1.600.474,78	1,12
XS1985806600 TORONTO DOMINION B 0,375%19-24	25/4/2019	25/4/2024	EUR	1.600	0,375	1.606.765,81	1,12
XS1987142673 BK OF NOVA SCOTIA 0,5%19-0424	30/4/2019	30/4/2024	EUR	2.000	0,50	2.005.726,03	1,39
TOTAL SUIZA						3.461.219,56	2,41
XS1400224546 EUROFIMA 1/4%16-250423 EMTN	25/4/2016	25/4/2023	EUR	3.400	0,25	3.461.219,56	2,41
TOTAL ALEMANIA						25.814.692,96	18,03
DE000A289DB1 BASF 0,101%20-050623	5/6/2020	5/6/2023	EUR	10	0,101	1.002.174,71	0,70
DE000A2DAJ57 KRED WIEDERAUFBAU 0,125%17-24	4/7/2017	4/10/2024	EUR	5.700	0,125	5.865.864,08	4,12
DE000A2TSTD0 SAP 0,25%18-100322	10/12/2018	10/3/2022	EUR	10	0,25	1.006.240,82	0,70
DE000DL19T18 DEUTSCHE BANK 0,375%18-180121	16/1/2018	18/1/2021	EUR	20	0,375	1.998.081,64	1,39
DE000NRW0F67 NORTH RHINE-W 1%14-160125	27/11/2014	16/1/2025	EUR	5.000	1,00	5.338.050,82	3,72
DE000NRW0GJ4 NORTH RHINE-W 0,375%15-0223	11/2/2015	16/2/2023	EUR	2.000	0,375	2.044.347,38	1,43

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% del Patrimonio neto
XS1068092839 MAHLE GMBH 2,5%14-140521	14/5/2014	14/5/2021	EUR	574	2,50	571.747,72	0,40
XS1114155283 ADIDAS 1,25%14-081021	8/10/2014	8/10/2021	EUR	700	1,25	712.980,10	0,50
XS1273507100 VOLKSWAGEN LEASING 0,75%15-20	11/8/2015	11/8/2020	EUR	1.500	0,75	1.510.800,49	1,05
XS1451539487 DEUTSCHE BAHN FIN 0%16-190721	19/7/2016	19/7/2021	EUR	1.000		1.001.150,00	0,70
XS1564325550 LANDW RENTENBANK 0,25%17-0724	13/2/2017	15/7/2024	EUR	2.000	0,25	2.060.182,40	1,44
XS2014292937 VOLKSWAGEN LEASING 0,5%19-0622	19/6/2019	20/6/2022	EUR	800	0,05	792.043,51	0,55
XS2023643146 MERCK FIN SERV 0,005%19-151223	5/7/2019	15/12/2023	EUR	12	0,005	1.196.468,79	0,83
XS2051667181 CONTINENTAL AG0923	12/9/2019	12/9/2023	EUR	730		714.560,50	0,50
TOTAL ESPAÑA						10.085.243,21	7,03
ES0224261042 CORES 1,5%15-271122	27/11/2015	27/11/2022	EUR	28	1,50	2.936.540,39	2,04
ES0378641312 FADE 0,5%18-170323	9/2/2018	17/3/2023	EUR	15	0,50	1.530.443,63	1,07
ES0378641346 FADE 0,05%19-170924	23/9/2019	17/9/2024	EUR	23	0,05	2.314.160,21	1,61
XS1759603761 PROSEGUR 1%18-080223	8/2/2018	8/2/2023	EUR	19	1,00	1.906.102,32	1,33
XS2014287937 BANCO SANTANDER 0,25%19-190624	19/6/2019	19/6/2024	EUR	14	0,25	1.397.996,66	0,98
TOTAL FRANCIA						19.559.314,71	13,64
FR0011062595 CREDIT LYONNAIS 4,40%11-130721	13/7/2011	13/7/2021	EUR	3.300.000	4,40	3.474.802,09	2,42
FR0011912872 INGENICO 2,5%14-200521	20/5/2014	20/5/2021	EUR	21	2,50	2.136.256,93	1,49
FR0013066669 HAVAS 1,875%15-081220	8/12/2015	8/12/2020	EUR	13	1,875	1.316.288,36	0,92
FR0013185444 CH.DIOR 0,75%16-240621	24/6/2016	24/6/2021	EUR	17	0,75	1.706.756,45	1,19
FR0013299591 BPIFRANCE FIN. 0,125%17-251123	30/11/2017	25/11/2023	EUR	20	0,125	2.032.182,73	1,42
FR0013358116 HSBC FRANCE 0,2%18-040921 EMTN	28/8/2018	4/9/2021	EUR	10	0,20	1.004.750,27	0,70
FR0013365491 SOCIETE GENERALE 0,25%18-0122	18/9/2018	18/1/2022	EUR	13	0,25	1.305.530,04	0,91
FR0013432770 BFCM 0,125%19-050224	4/7/2019	5/2/2024	EUR	21	0,125	2.097.827,47	1,46
FR0013444536 DASSAULT SYST. 0%19-160924	16/9/2019	16/9/2024	EUR	11		1.095.226,00	0,76
FR0013456423 PERNOD RICARD 0%19-241023	24/10/2019	24/10/2023	EUR	5		495.985,00	0,35
XS1113441080 THALES 2,125%14-230921 SR	23/9/2014	23/9/2021	EUR	1.500	2,125	1.550.521,52	1,08
XS1751347946 DEXIA CLF 0,5%18-170125	17/1/2018	17/1/2025	EUR	13	0,50	1.343.187,85	0,94
TOTAL REINO UNIDO						1.007.027,53	0,70
XS2016070430 WESTPAC SEC 0,3%19-250624	18/6/2019	25/6/2024	EUR	1.000	0,30	1.007.027,53	0,70

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% del Patrimonio neto
TOTAL ITALIA						9.520.310,17	6,64
IT0005025389 CDP 2,75%14-310521 EMTN	29/5/2014	31/5/2021	EUR	7.000	2,75	7.192.226,71	5,02
IT0005314544 CDP 0,75%17-211122	21/11/2017	21/11/2022	EUR	23	0,75	2.328.083,46	1,62
TOTAL JAPÓN						2.295.474,55	1,60
XS1577953760 ASAHI GROUP HD 0,321%17-190921	19/9/2017	19/9/2021	EUR	800	0,321	799.141,70	0,56
XS2004880832 MIZUHO FIN GROUP 0,523%19-0624	10/6/2019	10/6/2024	EUR	1.500	0,523	1.496.332,85	1,04
TOTAL PAÍSES BAJOS						7.534.328,40	5,25
DE000A190ND6 DAIMLER INTL 0,25%18-110522	11/5/2018	11/5/2022	EUR	1.000	0,25	996.156,16	0,69
XS1380394806 FERRARI 1,5%16-160323	16/3/2016	16/3/2023	EUR	1.500	1,50	1.556.787,53	1,10
XS1586555606 VW INTL FINANCE 0,5%17-300321	30/3/2017	30/3/2021	EUR	10	0,50	996.283,57	0,69
XS1914937021 ING 0,375%18-261121	26/11/2018	26/11/2021	EUR	11	0,375	1.107.506,24	0,77
XS1917577931 ABN AMRO 0,25%21	3/12/2018	3/12/2021	EUR	1.100	0,25	1.105.640,90	0,77
XS2010045271 SCHLUMBERGER FINANCE FR. 0% 151024	13/9/2019	15/10/2024	EUR	1.000		977.890,00	0,68
XS2118280218 SIEMENS FIN NV 0%20-200226	20/2/2020	20/2/2026	EUR	8		794.064,00	0,55
TOTAL SUECIA						3.270.837,92	2,28
XS2133390521 VATTENFAL 0,05%25	12/3/2020	15/10/2025	EUR	3.300	0,05	3.270.837,92	2,28
TOTAL ESTADOS UNIDOS DE AMÉRICA						2.837.513,00	1,98
XS1032978345 GOLDM.S.GRP_14/21	18/2/2014	18/10/2021	EUR	1.000	2,50	1.048.262,95	0,73
XS1987097430 WELLS FARGO 0,5%19-260424	26/4/2019	26/4/2024	EUR	1.800	0,50	1.789.250,05	1,25
TOTAL Bonos de tipo de variable revisable negociados en un mercado regulado o similar						999.612,67	0,70
TOTAL FRANCIA						999.612,67	0,70
FR0013264884 SAFRAN TV17-280621	28/6/2017	28/6/2021	EUR	10		999.612,67	0,70
TOTAL Bonos convertibles negociados en un mercado regulado o similar						1.016.706,00	0,71
TOTAL FRANCIA						1.016.706,00	0,71
FR0012658094 URW 0%15-0122 ORNANE	15/4/2015	1/1/2022	EUR	3.000		1.016.706,00	0,71
TOTAL Bonos indexados negociados en un mercado regulado o similar						4.486.254,20	3,13
TOTAL FRANCIA						4.486.254,20	3,13
FR0011427848 OATE 0,25%13-25072024 INDX	26/2/2013	25/7/2024	EUR	4.000.000	0,25	4.486.254,20	3,13

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% del Patrimonio neto
TOTAL Valores subordinados (TSR - TSDI)						8.950.611,27	6,24
TOTAL FINLANDIA						1.551.226,44	1,08
XS0544654162 NORDEA BANK 4%10-290321 EMTN	29/9/2010	29/3/2021	EUR	1.500	4,00	1.551.226,44	1,08
TOTAL FRANCIA						4.686.149,75	3,27
FR0010969410 BANQUE POSTALE 4,375%10-301120	30/11/2010	30/11/2020	EUR	30	4,375	3.127.920,41	2,18
XS0548803757 BFCM 4%10-22102020	22/10/2010	22/10/2020	EUR	30	4,00	1.558.229,34	1,09
TOTAL PAÍSES BAJOS						2.713.235,08	1,89
XS0557252417 COOP.RABOBK 3,75%10-091120	9/11/2010	9/11/2020	EUR	1.000	3,75	1.036.490,33	0,72
XS0826634874 COOP.RABOBK 4 1/8%12-140922	14/9/2012	14/9/2022	EUR	1.500	4,125	1.676.744,75	1,17
TOTAL Títulos de crédito						25.835.140,70	18,02
TOTAL Títulos de crédito negociados en un mercado regulado o similar						25.835.140,70	18,02
TOTAL Títulos de crédito negociables						25.835.140,70	18,02
TOTAL ALEMANIA						4.188.454,23	2,92
DE0001102465 ALLEMAGNE 0,25%19-150229	11/1/2019	15/2/2029	EUR	390.000.000	0,25	4.188.454,23	2,92
TOTAL ESPAÑA						10.893.526,28	7,60
ES00000124W3 ESPANA 3,8%14-300424	29/1/2014	30/4/2024	EUR	4.000	3,80	4.650.955,62	3,24
ES0000012B62 SPAIN 0,35%18-300723	17/5/2018	30/7/2023	EUR	6.100	0,35	6.242.570,66	4,36
TOTAL ITALIA						8.328.826,75	5,81
IT0004848831 ITALIE 5,5%12-011122	30/8/2012	1/11/2022	EUR	1.000	5,50	1.132.616,30	0,79
IT0004923998 ITALY 4,75%13-010944	22/5/2013	1/9/2044	EUR	3.000	4,75	4.510.489,20	3,15
IT0005344335 ITALY 2,45%18-011023	30/8/2018	1/10/2023	EUR	2.500	2,45	2.685.721,25	1,87
TOTAL PORTUGAL						2.424.333,44	1,69
PTOTEAOE0021 PORTUGAL 4,95%030608-251023	3/6/2008	25/10/2023	EUR	200.000.000	4,95	2.424.333,44	1,69
TOTAL Títulos de OIC						7.268.730,43	5,07
TOTAL OICVM y equivalentes de otros Estados miembros de la UE						7.268.730,43	5,07
TOTAL FRANCIA						7.268.730,43	5,07
FR0007004130 CM-CIC OBLI 7-10 (C)			EUR	214		1.089.407,66	0,76
FR0011153378 CM-CIC INFLATION (C)			EUR	56.514,75		6.179.322,77	4,31
TOTAL Contratos financieros						-1.360,00	0,00
TOTAL Contratos financieros con ajuste de márgenes de garantía						-1.360,00	0,00

Designación de los valores	Emisión	Vencimiento	Divisa	Cdad. núm. o nominal	Tipo	Valor bursátil	% del Patrimonio neto
TOTAL Compromisos a plazo firme						-1.360,00	0,00
FGBMU0F00002 BOBL-EUX 0920			EUR	34		19.380,00	0,00
TOTAL FRANCIA						-20.740,00	0,00
MARF.EUR Ajustes de margen futuros			EUR	-20.740		-20.740,00	-0,01

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.