

CM-AM INFLATION

Informationsdokument vom 30.09.2024

CM-AM INFLATION

Inhalt

VERMÖGENSAUFSTELLUNG IN EUR	3
ANZAHL DER ANTEILE IM UMLAUF UND NETTOINVENTARWERT PRO ANTEIL	4
BESTANDTEILE DES WERTPAPIERPORTFOLIOS IN EUR	5
VERÄNDERUNG DES WERTPAPIERBESTANDS IM BERICHTSZEITRAUM IN EUR	6
AUSSCHÜTTUNGEN IM BERICHTSZEITRAUM	7
VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH WÄHRUNG	8
VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH WIRTSCHAFTSSEKTOR	9
VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH DEM SITZLAND DES EMITTENTEN	10
AUFSCHLÜSSELUNG DER SONSTIGEN VERMÖGENSWERTE E) DES WERTPAPIERPORTFOLIOS NACH ART	11
AN DIE WERTENTWICKLUNG GEBUNDENE GEBÜHREN	12
AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)	13
AUFSTELLUNG DER DEVISEN-TERMINGESCHÄFTE	14
TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – AKTIEN	15
TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – ZINSSÄTZE	16
TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – DEVISEN	17
TERMINFINANZINSTRUMENTE – KREDITRISIKO	18
TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – SONSTIGE ENGAGEMENTS	19
AUFSTELLUNG DER DEVISEN-TERMINGESCHÄFTE (ZUR ABSICHERUNG EINER ANTEILSKLASSE VERWENDET)	20
TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – DEVISEN (ZUR ABSICHERUNG EINER ANTEILSKLASSE VERWENDET)	21
ZUSAMMENFASSENDE AUFSTELLUNG	22

CM-AM INFLATION

VERMÖGENSAUFSTELLUNG IN EUR

Bestandteile der Vermögensaufstellung	Betrag zum Abschluss des Berichtszeitraums *
a) Zulässige Finanzwerte gemäß Artikel L. 214-20 Absatz I, Satz 1 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes	87 611 157,84
b) Bankguthaben	600 235,26
c) Sonstige Aktiva des OGAW	3 189 433,32
d) Vom OGAW gehaltene Vermögenswerte insgesamt	91 400 826,42
e) Passiva	-3 048 992,44
f) Nettoinventarwert	88 351 833,98

* Negative Beträge sind mit einem Minuszeichen gekennzeichnet

CM-AM INFLATION

ANZAHL DER ANTEILE IM UMLAUF UND NETTOINVENTARWERT PRO ANTEIL

ISIN-Code der Anteilsklasse	Bezeichnung der Anteilsklasse	Verwendung der ausschüttungsfähigen Beträge	Währung der Anteilsklasse	Nettovermögen der Anteilsklasse (EUR)	Anzahl Anteile	Nettoinventarwert (EUR)
FR0014006FV6	ANTEILSKLASSE THES. IC	Thesaurierbar	EUR	1 025,80	0,010	102 580,00
FR0011153378	ANTEILSKLASSE THES. RC	Thesaurierbar	EUR	84 689 110,73	702 029,889426	120,63
FR0013299393	ANTEILSKLASSE THES. S	Thesaurierbar	EUR	3 661 697,45	30 322,544	120,75

CM-AM INFLATION

BESTANDTEILE DES WERTPAPIERPORTFOLIOS IN EUR

Bestandteile des Wertpapierbestands :	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
a) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Währungs- und Finanzgesetzbuchs regulierten Markt gehandelt werden	99,16	95,85
b) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist und in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Unterzeichnerstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum liegt, gehandelt werden	0,00	0,00
c) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die zum amtlichen Handel an einer Wertpapierbörse eines Drittstaats zugelassen sind oder an einem anderen organisierten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt eines Drittstaats gehandelt werden, sofern die betreffende Börse oder der betreffende Markt nicht auf einer von der AMF veröffentlichten Liste steht oder die Auswahl dieser Börse oder dieses Markts per Gesetz oder im Reglement oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist	0,00	0,00
d) Neu emittierte Finanztitel, die in Abschnitt I, Absatz 4 des Artikels R. 214-11 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) genannt sind	0,00	0,00
e) Sonstige Aktiva	0,00	0,00

CM-AM INFLATION

VERÄNDERUNG DES WERTPAPIERBESTANDS IM BERICHTSZEITRAUM IN EUR

Bestandteile des Wertpapierbestands :	Veränderung (Betrag)	
	Käufe	Veräußerungen
a) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die an einem im Sinne von Artikel L. 422-1 des französischen Währungs- und Finanzgesetzbuchs regulierten Markt gehandelt werden	3 893 267,42	9 852 004,67
b) Zulässige Wertpapiere und Geldmarktinstrumente, die an einem anderen geregelten Markt, der anerkannt, für das Publikum offen und dessen Funktionsweise ordnungsgemäß ist und in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in einem anderen Unterzeichnerstaat des Abkommens über den Europäischen Wirtschaftsraum liegt, gehandelt werden	0,00	0,00
c) Zulässige Finanztitel und Geldmarktinstrumente, die zum amtlichen Handel an einer Wertpapierbörse eines Drittstaats zugelassen sind oder an einem anderen organisierten, anerkannten, für das Publikum offenen und ordnungsgemäß funktionierenden Markt eines Drittstaats gehandelt werden, sofern die betreffende Börse oder der betreffende Markt nicht auf einer von der AMF veröffentlichten Liste steht oder die Auswahl dieser Börse oder dieses Markts per Gesetz oder im Reglement oder in der Satzung des Organismus für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren vorgesehen ist	0,00	0,00
d) Neu emittierte Finanztitel, die in Abschnitt I, Absatz 4 des Artikels R. 214-11 des französischen Währungs- und Finanzgesetzes (Code monétaire et financier) genannt sind	0,00	0,00
e) Sonstige Aktiva	0,00	0,00

Veränderung im Berichtszeitraum	Veränderung (Betrag)
Käufe	3 893 267,42
Veräußerungen	9 852 004,67

AUSSCHÜTTUNGEN IM BERICHTSZEITRAUM

Keine Ausschüttung während des Berichtszeitraums

CM-AM INFLATION

VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH WÄHRUNG

Währung	Betrag (EUR)	Prozentsatz	
		Nettovermögen	Gesamtvermögen
Euro	87 611 157,84	99,16	95,85
Summe	87 611 157,84	99,16	95,85

CM-AM INFLATION

VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH WIRTSCHAFTSSEKTOR

Wirtschaftssektor	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
Staatsanleihen	99,16	95,85
Summe	99,16	95,85

CM-AM INFLATION

VERTEILUNG DER VERMÖGENSWERTE A), B), C) UND D) NACH DEM SITZLAND DES EMITTENTEN

Land	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
Frankreich	42,73	41,31
Italien	24,52	23,70
Spanien	16,34	15,79
Deutschland	15,57	15,05
Summe	99,16	95,85

CM-AM INFLATION

AUFSCHLÜSSELUNG DER SONSTIGEN VERMÖGENSWERTE E) DES WERTPAPIERPORTFOLIOS NACH ART

Art des Wertpapiers	Prozentsatz	
	Nettovermögen	Gesamtvermögen
OGA-Anteile	0,00	0,00
Summe OGAW und vergleichbare Titel aus anderen EU-Mitgliedstaaten	0,00	0,00
Summe AIF und vergleichbare Titel aus anderen EU-Mitgliedstaaten	0,00	0,00
Sonstige OGA und Investmentfonds	0,00	0,00
Sonstige Aktiva	0,00	0,00
Summe	0,00	0,00

CM-AM INFLATION

AN DIE WERTENTWICKLUNG GEBUNDENE GEBÜHREN

ANTEILSKLASSE THES. IC	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	0,00
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,00

ANTEILSKLASSE THES. RC	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	0,00
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,00

ANTEILSKLASSE THES. S	30.09.2024
An die Wertentwicklung gebundene Gebühren (variable Kosten)	0,00
Prozentualer Anteil der an die Wertentwicklung gebundenen	0,00

CM-AM INFLATION

AUFSTELLUNG DER ZULÄSSIGEN AKTIVA UND PASSIVA (OHNE TFI)

Instrumente	Währung	Menge	Betrag	%NV
Anleihen			87 611 157,84	99,16
Sonstige an einem geregelten oder ähnlichen Markt gehandelte Anleihen und ähnliche Wertpapiere			87 611 157,84	99,16
Staatsanleihen			87 611 157,84	99,16
DEUTSCHLAND TV14-150430 INF TV14-150430 INFLAT.	EUR	510 000 000	6 554 007,88	7,42
DEUTSCHLAND TV15-150426 INFLAT.	EUR	340 000 000	4 241 329,22	4,80
DEUTSCHLAND TV21-150433INFLATION	EUR	250 000 000	2 963 541,29	3,35
SPANIEN 1%15-301130 INDX	EUR	5 100	6 550 133,11	7,41
FRTR 0.6 07/25/34	EUR	700 000	742 181,90	0,84
FRTR 3.4 07/25/29	EUR	1 600 000	2 664 817,23	3,02
ITALIEN TV15-150932 INFLATION	EUR	4 500	5 635 059,17	6,38
ITALIEN TV17-150528 INFLATION	EUR	3 800	4 841 605,07	5,48
ITALIEN TV19-150530 INFLATION	EUR	3 600	4 195 702,27	4,75
ITALIEN TV22-150533	EUR	1 000	1 038 728,98	1,18
ITALIEN TV20-150526 INFLATI	EUR	5 000	5 953 608,75	6,74
OAT 0,10%17-01032028 INDX	EUR	7 300 000	8 436 033,24	9,55
OATE 0,10%19-01032029 INDX	EUR	3 200 000	3 766 708,42	4,26
OATE 1,85%11-25072027 INDX	EUR	6 100 000	8 516 016,47	9,64
OATE 3,15%02-25072032 INDX	EUR	3 700 000	6 820 226,52	7,72
OATEI0,10%21-250731 INDX	EUR	1 600 000	1 842 709,92	2,08
OATEI 0,70%14-250730	EUR	3 500 000	4 424 737,28	5,01
OATI 0,10%21-010332 INDX	EUR	500 000	539 698,39	0,61
SPANIEN TV18-301133 INFLATION	EUR	6 500	7 884 312,73	8,92
Summe			87 611 157,84	99,16

CM-AM INFLATION

AUFSTELLUNG DER DEWISEN-TERMINGESCHÄFTE

Bezeichnung d. Instruments	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)			
	Aktiva	Passiva	Fremdwährungs-forderungen (+)		Zu liefernde Währungen (-)	
			Währung	Betrag (*)	Währung	Betrag (*)
Summe	0,00	0,00		0,00		0,00

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM INFLATION

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – AKTIEN

Termin-Finanzinstrumente – Aktien				
Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Futures				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Optionen				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Sonstige Instrumente				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM INFLATION

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – ZINSSÄTZE

Termin-Finanzinstrumente – Zinssätze				
Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Futures				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Optionen				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Sonstige Instrumente				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM INFLATION

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – DEWISEN

Termin-Finanzinstrumente – Devisen				
Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Futures				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Optionen				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Sonstige Instrumente				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM INFLATION

TERMINFINANZINSTRUMENTE – KREDITRISIKO

Terminfinanzinstrumente – Kreditrisiko				
Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Futures				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Optionen				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Sonstige Instrumente				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM INFLATION

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – SONSTIGE ENGAGEMENTS

Termin-Finanzinstrumente – Sonstige Engagements				
Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)
		Aktiva	Passiva	+/-
Futures				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Optionen				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Sonstige Instrumente				
Untersumme		0,00	0,00	0,00
Summe		0,00	0,00	0,00

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM INFLATION

AUFSTELLUNG DER DEWISEN-TERMINGESCHÄFTE (ZUR ABSICHERUNG EINER ANTEILSKLASSE VERWENDET)

Bezeichnung d. Instruments	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)				Abgesicherte Anteilsklasse
	Aktiva	Passiva	Fremdwährungs-forderungen (+)		Zu liefernde Währungen (-)		
			Währung	Betrag (*)	Währung	Betrag (*)	
Summe	0,00	0,00		0,00		0,00	

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM INFLATION

TERMIN-FINANZINSTRUMENTE – DEVISEN (ZUR ABSICHERUNG EINER ANTEILSKLASSE VERWENDET)

Bezeichnung d. Instruments	Menge/Nennwert	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert		Betrag des Engagements in Euro (*)	Abgesicherte Anteilsklasse
		Aktiva	Passiva	+/-	
Futures					
Untersumme		0,00	0,00	0,00	
Optionen					
Untersumme		0,00	0,00	0,00	
Swaps					
Untersumme		0,00	0,00	0,00	
Sonstige Instrumente					
Untersumme		0,00	0,00	0,00	
Summe		0,00	0,00	0,00	

(*) Der Betrag wird nach den Bestimmungen der Verordnung über den Ausweis von Engagements festgelegt.

CM-AM INFLATION

ZUSAMMENFASSENDE AUFSTELLUNG

	In der Bilanz ausgewiesener aktueller Wert
Summe Aufstellung der zulässigen Aktiva und Passiva (ohne TFI)	87 611 157,84
Aufstellung der TFI (ohne TFI, die zur Absicherung ausgegebener Anteile verwendet werden):	
Summe Devisen-Termingeschäfte	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Aktien	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Zinssätze	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Devisen	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Anleihen	0,00
Summe Termin-Finanzinstrumente – Sonstige Engagements	0,00
Aufstellung der Termin-Finanzinstrumente, die zur Absicherung ausgegebener Anteile verwendet werden	0,00
Sonstige Aktiva (+)	3 789 668,58
Sonstige Passiva (-)	-3 048 992,44
Summe = Nettovermögen	88 351 833,98

ZUSÄTZLICHE INFORMATIONEN FÜR ANLEGER IN DER BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND

- a) Zahl- und Informationsstelle in Deutschland

TARGOBANK AG, Kasernenstraße 10, 40213 Düsseldorf

- b) Ausgabeanträge, Rücknahmegesuche und Konversionsanträge

Anträge zur Ausgabe von Aktien, Rücknahmegesuche und, falls erforderlich, die mit dem Rücknahmegesuch einzureichenden Aktienzertifikate sowie Konversionsanträge für die in Deutschland vertriebsberechtigten Teilfonds können bei der Zahlstelle eingereicht werden.

- c) Rücknahmemeerlöse, Ausschüttungen und sonstige etwaige Zahlungen an die Aktionäre

Rücknahmemeerlöse, Ausschüttungen sowie sonstige etwaige Zahlungen an die Aktionäre können in der Bundesrepublik Deutschland über die oben genannte Zahlstelle auch in bar bezogen werden.

- d) Informationen an die Anleger Der ausführliche Verkaufsprospekt, die Ausgabe und Rücknahmepreise, die Wesentlichen Anlegerinformation bzw. Basisinformationsblatt, die Satzung sowie die aktuellen Jahres- und Halbjahresberichte sind bei der TARGOBANK AG, Kasernenstraße 10, 40213 Düsseldorf kostenlos erhältlich. In der Bundesrepublik Deutschland werden die Ausgabe- und Rücknahmepreise der Investmentanteile in der „Börsen- Zeitung“ und etwaige sonstige Mitteilungen an die Anleger im elektronischen Bundesanzeiger veröffentlicht.

- e) Beschwerden können kostenlos an die Zahl- und Informationsstelle TARGOBANK AG, Kasernenstraße 10, 40213 Düsseldorf, Deutschland, oder an die Verwaltungsgesellschaft CM-AM SICAV, 4 rue Gaillon - 75002 PARIS, gerichtet werden.

VERÖFFENTLICHUNG VON PREISEN UND MITTEILUNGEN AN DIE AKTIONÄRE

Die jüngsten Ausgabe- und Rücknahmepreise für die Anteile (Nettoinventarwert) werden auf der Website der Gesellschaft unter www.creditmutuel-am.eu veröffentlicht.

Informationen und Mitteilungen an die Anteilinhaber werden auf der Website der Gesellschaft unter www.creditmutuel-am.eu veröffentlicht und sind bei der Fazilitätsstelle erhältlich.

In den folgenden Fällen werden die Mitteilungen an die Aktionäre in Deutschland auf einem dauerhaften Datenträger veröffentlicht und zusätzlich auf der Website der Gesellschaft, www.creditmutuel-am.eu :

- - Aussetzung des Rückkaufs von Anteilen der Gesellschaft oder eines ihrer Teilfonds;
- - Beendigung der Verwaltung oder Auflösung der Gesellschaft oder eines ihrer Teilfonds;
- Änderungen der Bedingungen, die nicht mit der bestehenden Anlagepolitik vereinbar sind, die wesentliche Rechte der Anteilhaber berühren oder die Erstattung von Kosten betreffen, die von der Gesellschaft übernommen werden können Änderungen der Anlagebedingungen, die nicht mit der bestehenden Anlagepolitik vereinbar sind, die wesentliche Rechte der Anteilhaber berühren oder die sich auf die Erstattung von Aufwendungen auswirken, die von der Gesellschaft übernommen werden können, einschließlich der Gründe für die Änderungen und der Rechte der Anteilhaber in verständlicher Form sowie ihrer Möglichkeiten, sich darüber zu informieren; Im Falle einer Verschmelzung der Gesellschaft oder eines ihrer Teilfonds in Form von Verschmelzungsinformationen, die gemäß Artikel 43 der Richtlinie 2009/65/EG zu erstellen sind;
- Im Falle der Umwandlung der Gesellschaft oder eines ihrer Teilfonds in einen Feeder-Fonds. - Im Falle der Umwandlung der Gesellschaft oder eines ihrer Teilfonds in einen Feeder-Fonds.
- Im Falle einer Änderung eines Master-Fonds, in Form von Informationen, die gemäß Artikel 64 der Richtlinie 2009/65/E