



29/12/2023

Fonds de droit français

**GROUPAMA ULTRA
SHORT TERM BOND**

RAPPORT SEMESTRIEL

ETAT DU PATRIMOINE EN EUR

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier	1 348 275 017,73
b) Avoirs bancaires	16 677 506,31
c) Autres actifs détenus par l'OPC	56 158 569,00
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	1 421 111 093,04
e) Passif	-30 344 003,26
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	1 390 767 089,78

* Les montants sont signés

NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND EI en EUR	C	1 008,74	10,000	100,87
GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND G en EUR	C/D	33 741 155,79	3 321,901	10 157,18
GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND IC en EUR	C	958 741 269,12	92 695,802	10 342,87
GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND ID en EUR	D	3 745 396,06	383,352	9 770,12
GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND MC en EUR	C	73 220 023,25	70 804,358	1 034,11
GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND N en EUR	C	262 415 808,81	2 546 071,748	103,06
GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND R en EUR	C	58 902 428,01	57 018,378	1 033,04

ELEMENT DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
<p>A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-I du code monétaire et financier.</p> <p>Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.</p>	70,75	69,23
<p>C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.</p>	26,20	25,64
<p>D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.</p>		
<p>E) Les autres actifs.</p>	2,16	2,11

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Euro	EUR	1 336 723 732,30	96,11	94,06
Livre Sterling	GBP	11 551 285,43	0,83	0,81
TOTAL		1 348 275 017,73	96,94	94,87

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RESIDENCE DE L'EMETTEUR

Pays	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
FRANCE	25,49	24,95
ITALIE	11,14	10,90
ETATS-UNIS	10,85	10,62
ESPAGNE	9,76	9,55
ROYAUME-UNI	8,51	8,33
IRLANDE	6,52	6,38
SUISSE	5,76	5,64
LUXEMBOURG	4,17	4,08
PAYS-BAS	4,12	4,03
ALLEMAGNE	3,28	3,21
BELGIQUE	1,87	1,83
DANEMARK	1,86	1,82
NORVEGE	1,74	1,70
SUEDE	0,79	0,78
CANADA	0,72	0,71
JAPON	0,36	0,35
TOTAL	96,94	94,87

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

REPARTITION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE

Nature d'actifs	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Organismes de placement collectif		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	2,16	2,11
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE		
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés		
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés		
Autres organismes non européens		
Autres actifs		
Autres		
TOTAL	2,16	2,11

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE EN EUR

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-I du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	848 072 887,07	819 651 042,83
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	204 049 960,50	178 774 173,60
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-I I du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	448 091 346,82	518 255 940,11

DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE

	Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
Dividendes versés				
17/10/2023	GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND G	317,48		317,48
17/10/2023	GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND ID	302,58		302,58
Dividendes à verser				
	GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND G			
	GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND ID			

INFORMATIONS DIVERSES

Etablissement dépositaire : Caceis Bank - 12 place des États-Unis - CS 40083 - 92549 - Montrouge Cedex

Le relevé Périodicité Semestrielle détaillé de l'actif est disponible dans un délai de huit semaines à compter de la fin de la période. Il peut être transmis sur simple demande auprès de la société de gestion :

GROUPAMA ASSET MANAGEMENT - 25 rue de la Ville l'Evêque - 75008 - Paris

INFORMATION SUR LES FRAIS DE GESTION VARIABLES

	29/12/2023
Parts GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND EI	
Frais de gestion variables provisionnés	0,06
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,01
Frais de gestion variables acquis	
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	
Parts GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND G	
Frais de gestion variables provisionnés	
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	
Frais de gestion variables acquis	
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	
Parts GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND IC	
Frais de gestion variables provisionnés	147 595,08
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,01
Frais de gestion variables acquis	32 303,23
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	
Parts GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND ID	
Frais de gestion variables provisionnés	330,52
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,01
Frais de gestion variables acquis	
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	
Parts GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND MC	
Frais de gestion variables provisionnés	1 527,11
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	
Frais de gestion variables acquis	0,46
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	

« Le montant des frais de gestion variables affiché ci-dessus correspond à la somme des provisions et reprises de provisions ayant impacté l'actif net au cours de la période sous revue.»

	29/12/2023
Parts GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND N	
Frais de gestion variables provisionnés	45 523,81
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,02
Frais de gestion variables acquis	9 750,17
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,01
Parts GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND R	
Frais de gestion variables provisionnés	11 490,78
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,03
Frais de gestion variables acquis	4 114,15
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,01

« Le montant des frais de gestion variables affiché ci-dessus correspond à la somme des provisions et reprises de provisions ayant impacté l'actif net au cours de la période sous revue.»

TRANSPARENCE DES OPERATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA REUTILISATION DES INSTRUMENTS FINANCIERS - REGLEMENT SFTR - en devise de comptabilité de l'OPC (EUR)

Au cours de l'exercice, l'OPC n'a pas fait l'objet d'opérations relevant de la réglementation SFTR.

PORTEFEUILLE TITRES AU 29/12/2023 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
HAMBURG COMMERCIAL BANK AG E E3R+1.6% 05-12-25	EUR	10 000 000	10 043 788,89	0,72
VOLKSWAGEN BANK 4.25% 07-01-26	EUR	20 000 000	20 811 047,95	1,49
TOTAL ALLEMAGNE			30 854 836,84	2,21
BELGIQUE				
BELFIUS BANK 0.375% 13-02-26	EUR	2 300 000	2 162 261,66	0,15
KBC GROUPE 2.875% 29-06-25	EUR	7 000 000	7 057 559,32	0,51
KBC GROUPE 4.5% 06-06-26 EMTN	EUR	16 200 000	16 803 492,49	1,21
TOTAL BELGIQUE			26 023 313,47	1,87
CANADA				
CAN IMP BK E3R+0.5% 09-06-25	EUR	10 000 000	10 043 251,94	0,72
TOTAL CANADA			10 043 251,94	0,72
DANEMARK				
NYKREDIT REALKREDIT AS 0.625% 17-01-25	EUR	5 878 000	5 734 901,70	0,42
TOTAL DANEMARK			5 734 901,70	0,42
ESPAGNE				
ABANCA CORPORACION BANCARIA 5.5% 18-05-26	EUR	4 700 000	4 939 572,36	0,36
BANCO DE BADELL 1.125% 27-03-25	EUR	8 900 000	8 698 174,99	0,62
BANCO NTANDER 0.1% 26-01-25	EUR	20 000 000	19 970 639,73	1,44
BANCO NTANDER 1.125% 17-01-25	EUR	14 000 000	13 778 848,90	1,00
BANCO NTANDER 3.75% 16-01-26	EUR	10 000 000	10 445 993,84	0,75
CAIXABANK 0.625% 01-10-24 EMTN	EUR	23 600 000	23 093 430,51	1,66
Santander Consumer Finance E3R+0.48% 14-03-25	EUR	10 000 000	10 033 738,89	0,72
SANT ISS 2.5% 18-03-25 EMTN	EUR	20 100 000	20 230 188,69	1,45
TOTAL ESPAGNE			111 190 587,91	8,00
ETATS-UNIS				
ATHENE GLOBAL FUNDING 1.241% 08-04-24	EUR	16 700 000	16 723 963,13	1,20
ATT 3.55% 18-11-25	EUR	7 800 000	7 878 169,64	0,56
BK AMERICA FIX 07-02-25 EMTN	EUR	28 560 000	28 848 532,29	2,07
CAPITAL ONE FINANCIAL 0.8% 12-06-24	EUR	30 350 000	30 002 670,79	2,16
CITIGROUP 1.25% 06-07-26 EMTN	EUR	12 678 000	12 287 982,81	0,88
F 2.33 11/25/25	EUR	5 000 000	4 873 188,93	0,35
FORD MOTOR CREDIT 3.25% 15-09-25	EUR	2 095 000	2 090 931,01	0,15
FORD MOTOR CREDIT CO LLC	GBP	10 000 000	11 551 285,43	0,84
GENERAL MOTORS FINANCIAL 1.0% 24-02-25	EUR	10 000 000	9 790 253,42	0,71
KRAFT HEINZ FOODS E3R+0.5% 09-05-25	EUR	12 500 000	12 600 975,69	0,90
PVH EX PHIL V 3.625% 15-07-24	EUR	14 000 000	14 207 101,09	1,02
TOTAL ETATS-UNIS			150 855 054,23	10,84

PORTEFEUILLE TITRES AU 29/12/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
FRANCE				
ARVAL SERVICE LEASE 0.875% 17-02-25	EUR	13 000 000	12 675 666,03	0,91
BFCM BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL 1.0% 23-05-25	EUR	5 000 000	4 862 862,70	0,35
BNP PAR 1.25% 19-03-25 EMTN	EUR	3 500 000	3 439 990,30	0,25
BNP PAR CARDIF 1.0% 29-11-24	EUR	15 800 000	15 374 052,29	1,11
BPCE 1.0% 01-04-25 EMTN	EUR	12 000 000	11 722 779,67	0,84
BPCE 2.25% 12-03-25	EUR	7 600 000	7 608 726,30	0,55
BPCE 2.875% 22-04-26 EMTN	EUR	8 200 000	8 290 604,17	0,60
BPCE 3.625% 17-04-26 EMTN	EUR	11 200 000	11 590 212,59	0,83
BQ POSTALE 0.5% 17-06-26 EMTN	EUR	10 000 000	9 583 322,40	0,69
CAIXA GEN S A 2.875% 15-06-26	EUR	2 600 000	2 607 858,46	0,19
COFACE S A E 4.125% 27-03-24	EUR	3 800 000	3 916 993,59	0,28
INDIGO GROUP SAS 2.125% 16-04-25	EUR	2 500 000	2 484 016,87	0,18
LA MONDIALE 0.75% 20-04-26	EUR	7 600 000	7 175 972,33	0,52
PSA BANQUE FRANCE 0.0% 22-01-25	EUR	10 600 000	10 200 592,00	0,74
RCI BANQUE 4.125% 01-12-25	EUR	10 000 000	10 112 142,62	0,72
RENAULT CREDIT INTERNATIONAL BANQUE SA E3R+0.58% 12-03-25	EUR	13 600 000	13 631 733,33	0,98
RENAULT CREDIT INTL BANQUE 2.0% 11-07-24	EUR	15 000 000	14 992 837,30	1,08
SG 1.125% 23-01-25 EMTN	EUR	10 000 000	9 830 885,62	0,70
THALES SERVICES SAS 4.0% 18-10-25	EUR	13 400 000	13 692 392,03	0,98
TOTAL FRANCE			173 793 640,60	12,50
IRLANDE				
AIB GROUP 1.25% 28-05-24 EMTN	EUR	10 000 000	9 966 986,61	0,72
CA AUTO BANK SPA IRISH BRANCH 4.375% 08-06-26	EUR	12 900 000	13 435 323,21	0,96
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 0.0% 16-04-24	EUR	6 700 000	6 629 181,00	0,48
PERMANENT TSB GROUP 5.25% 30-06-25	EUR	16 000 000	16 441 020,33	1,18
TOTAL IRLANDE			46 472 511,15	3,34
ITALIE				
INTE 1.7% 13-03-24	EUR	7 400 000	7 463 370,89	0,54
INTE E3R-4+1.56% 13-03-24	EUR	800 000	804 275,85	0,07
IREIM 1.95 09/19/25	EUR	7 000 000	6 886 897,79	0,50
LEASYS ZCP 22-07-24	EUR	5 000 000	4 894 325,00	0,35
MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ 1.6% 25-01-24	EUR	10 971 000	11 178 174,56	0,80
MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ E3R+0.0% 31-03-24	EUR	4 605 000	4 594 255,00	0,33

PORTEFEUILLE TITRES AU 29/12/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ E3R+0.25% 30-09-24	EUR	3 500 000	3 475 412,50	0,25
MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ E3R+1.7% 25-01-24	EUR	9 500 000	9 610 083,89	0,69
SOCIETA PER LA GESTIONE DI ATTIVITA 1.375% 27-01-25	EUR	11 500 000	11 351 717,74	0,81
SOCIETA PER LA GESTIONE DI ATTIVITA 2.625% 13-02-24	EUR	13 000 000	13 273 927,81	0,95
UBI BANCA UNIONE DI BANCHE ITALIANE 2.625% 20-06-24	EUR	8 000 000	8 058 472,79	0,58
UNICREDIT 0.5% 09-04-25 EMTN	EUR	7 000 000	6 754 894,04	0,49
UNICREDIT SPA E3R+0.7% 31-08-24	EUR	8 849 000	8 899 457,74	0,64
TOTAL ITALIE			97 245 265,60	7,00
JAPON				
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP 3.273% 19-09-25	EUR	5 000 000	5 017 920,90	0,35
TOTAL JAPON			5 017 920,90	0,35
LUXEMBOURG				
TRATON FINANCE LUXEMBOURG 4.125% 18-01-25	EUR	13 000 000	13 560 817,33	0,98
TRATON FINANCE LUXEMBOURG E3R+1.0% 21-01-26	EUR	15 000 000	15 140 085,00	1,08
TRATON FINANCE LUXEMBOURG E3RJ+0.85% 17-02-24	EUR	9 300 000	9 361 697,23	0,67
TOTAL LUXEMBOURG			38 062 599,56	2,73
NORVEGE				
SANTANDER CONSUMER BANK AS 0.125% 11-09-24	EUR	24 800 000	24 185 067,74	1,74
TOTAL NORVEGE			24 185 067,74	1,74
PAYS-BAS				
ABN AMRO BK 3.75% 20-04-25	EUR	20 000 000	20 603 488,52	1,48
ING GROEP NV 0.125% 29-11-25	EUR	23 000 000	22 223 049,32	1,60
LEASEPLAN CORPORATION NV 2.125% 06-05-25	EUR	12 000 000	11 955 306,56	0,86
NIBC BANK NV 2.0% 09-04-24	EUR	2 500 000	2 521 211,13	0,18
TOTAL PAYS-BAS			57 303 055,53	4,12
ROYAUME-UNI				
BARCLAYS 0.75% 09-06-25 EMTN	EUR	8 000 000	7 914 898,36	0,57
BARCLAYS 3.375% 02-04-25 EMTN	EUR	38 740 000	39 629 502,15	2,85
HITACHI CAPITAL UK 0.0% 29-10-24	EUR	25 120 000	24 281 494,40	1,74
LLOYDS BANKING GROUP 3.5% 01-04-26	EUR	8 000 000	8 190 632,57	0,59
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROUP 1.75% 02-03-26	EUR	10 000 000	9 886 489,62	0,71
ROYAL MAIL 2.375% 29-07-24	EUR	3 338 000	3 338 660,03	0,24
STAN 3.125% 19-11-24 EMTN	EUR	5 000 000	4 981 286,07	0,36
TOTAL ROYAUME-UNI			98 222 963,20	7,06
SUEDE				
SWEDISH MATCH AB 1.2% 10-11-25	EUR	5 229 000	5 012 626,55	0,37
SWED MATC AB 0.875% 23-09-24	EUR	6 143 000	6 011 162,16	0,43
TOTAL SUEDE			11 023 788,71	0,80

PORTEFEUILLE TITRES AU 29/12/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SUISSE				
CREDIT SUISSE GROUP AG 1.25% 17-07-25	EUR	28 600 000	28 304 447,91	2,04
CRED SUIS SA GROUP AG 2.125% 13-10-26	EUR	10 000 000	9 767 859,29	0,70
UBS GROUP AG 1.0% 21-03-25	EUR	22 000 000	22 023 404,75	1,59
UBS GROUP AG 1.25% 17-04-25	EUR	20 000 000	20 013 778,69	1,43
TOTAL SUISSE			80 109 490,64	5,76
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			966 138 249,72	69,46
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			966 138 249,72	69,46
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
SANTANDER CONSUMER BANK AG 240524 FIX 0.	EUR	15 000 000	14 753 836,35	1,06
TOTAL ALLEMAGNE			14 753 836,35	1,06
DANEMARK				
JYSKE BANK DNK 050824 OISEST 0.2	EUR	20 000 000	20 132 089,14	1,45
TOTAL DANEMARK			20 132 089,14	1,45
ESPAGNE				
BBVA ZCP 21-06-24	EUR	25 000 000	24 516 536,41	1,76
TOTAL ESPAGNE			24 516 536,41	1,76
FRANCE				
ACCOR SA 220124 FIX 0.0	EUR	8 000 000	7 980 001,15	0,57
ALSTOM SA 310124 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 926 027,26	1,43
ARVAL SERVICE LEASE SA 120124 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 972 722,94	1,44
ARVAL SERVICE LEASE SA 190424 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 689 274,67	1,77
DECATHLON SA 110124 FIX 0.0	EUR	8 000 000	7 989 948,70	0,58
LCL CREDIT LYONNAIS 090124 OISEST 0.11	EUR	20 000 000	20 183 662,49	1,45
ORANO SA 230224 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 938 188,03	0,72
PSA BANQUE FRANCE 090924 OISEST 0.29	EUR	20 000 000	20 045 916,22	1,44
PSA BANQUE FRANCE 300724 OISEST 0.28	EUR	25 000 000	25 175 642,09	1,81
THALES SERVICES SAS 011124 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 691 518,29	0,70
VEOLIA ENVIRONNEMENT 190124 OISEST 0.095	EUR	15 000 000	15 120 075,34	1,08
TOTAL FRANCE			180 712 977,18	12,99
IRLANDE				
BARCLAYS BANK IRELAND PLC 271224 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 327 738,31	1,39
TOTAL IRLANDE			19 327 738,31	1,39
LUXEMBOURG				
ARCELORMITTAL 310124 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 929 067,98	1,44
TOTAL LUXEMBOURG			19 929 067,98	1,44
TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			279 372 245,37	20,09

PORTEFEUILLE TITRES AU 29/12/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
IRLANDE				
ARABELLA FINAN 290124 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 947 612,77	1,07
CA AUTO BANK S.P.A. 100124 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 988 835,75	0,72
TOTAL IRLANDE			24 936 448,52	1,79
ITALIE				
SNAM SPA 050224 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 919 063,68	1,43
SNAM SPA 180124 FIX 0.0	EUR	18 000 000	17 963 642,23	1,29
SNAM SPA 200324 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 820 514,15	1,43
TOTAL ITALIE			57 703 220,06	4,15
ROYAUME-UNI				
THE TORONTO-DOMIN 041124 OIEST 0.3	EUR	20 000 000	20 124 854,06	1,45
TOTAL ROYAUME-UNI			20 124 854,06	1,45
TOTAL Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé			102 764 522,64	7,39
TOTAL Titres de créances			382 136 768,01	27,48
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
GROUPAMA MONETAIRE IC	EUR	68,281	15 002 705,42	1,08
GROUPAMA TRESORERIE IC	EUR	363,9307	15 002 358,92	1,08
TOTAL FRANCE			30 005 064,34	2,16
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			30 005 064,34	2,16
TOTAL Organismes de placement collectif			30 005 064,34	2,16
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
EURO SCHATZ 0324	EUR	-700	-519 155,00	-0,04
SHORT EUR-BTP 0324	EUR	-1 200	-1 195 110,00	-0,08
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			-1 714 265,00	-0,12
TOTAL Engagements à terme fermes			-1 714 265,00	-0,12
Engagements à terme conditionnels				
Engagements à terme conditionnels sur marché réglementé				
EUREX EURO SCHATZ 01/2024 PUT 105.6	EUR	-1 000	95 000,00	0,01
EUREX EURO SCHATZ 01/2024 PUT 106	EUR	1 000	-220 000,00	-0,02
LIFFE 3M EURIBOR 03/2025 PUT 96	EUR	-1 000	-3 125,00	
LIFFE 3M EURIBOR 03/2025 PUT 97	EUR	500	-21 875,00	
TOTAL Engagements à terme conditionnels sur marché réglementé			-150 000,00	-0,01
TOTAL Engagements à terme conditionnels			-150 000,00	-0,01

PORTEFEUILLE TITRES AU 29/12/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				
FIX/0.0/FIX/1.5897	EUR	40 000 000	878 885,20	0,07
FIX/0.0/FIX/2.9702	EUR	10 000 000	60 592,20	0,01
FIX/3.8773/OISEST/0.	EUR	100 000 000	1 494,00	
OISEST/0.0/FIX/-0.35	EUR	50 000 000	1 758 131,50	0,13
OISEST/0.0/FIX/-0.36	EUR	50 000 000	1 926 827,50	0,13
OISEST/0.0/FIX/-0.56	EUR	40 000 000	1 655 727,20	0,11
OISEST/0.0/FIX/0.912	EUR	100 000 000	4 484 720,00	0,32
OISEST/0.0/FIX/3.382	EUR	30 000 000	2 301,00	
TOTAL Swaps de taux			10 768 678,60	0,77
Credit Default Swap				
SJ Fictif pour CDS_2	EUR	-20 000 000	-154 195,56	-0,01
TOTAL Credit Default Swap			-154 195,56	-0,01
TOTAL Autres instruments financiers à terme			10 614 483,04	0,76
TOTAL Instrument financier à terme			8 750 218,04	0,63
Appel de marge				
APPEL MARGE CACEIS	EUR	297 500	297 500,00	0,03
APPEL MARGE JP MORGA	EUR	1 566 765	1 566 765,00	0,11
TOTAL Appel de marge			1 864 265,00	0,14
Créances			13 425 561,06	0,96
Dettes			-28 230 542,69	-2,03
Comptes financiers			16 677 506,30	1,20
Actif net			1 390 767 089,78	100,00