30/06/2022

Fonds de droit français

GROUPAMA FP FLEXIBLE ALLOCATION

RAPPORT SEMESTRIEL

Groupama ASSET MANAGEMENT

Gestionnaire Activement Responsable

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	
b) Avoirs bancaires	10 978 497,27
c) Autres actifs détenus par l'OPC	243 419 817,07
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	254 398 314,34
e) Passif	-47 490 420,74
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	206 907 893,60

*** 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 FP FLEXIBLE ALLOCATION I en EUR	C	197 753 445,05	17 982,897000	10 996,75
GROUPAMA FP FLEXIBLE ALLOCATION N en EUR	C	9 154 448,55	19 258,9200	475,33

ELEMENT DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
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. 422-1 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.		
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.		
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	94,66	76,99

* *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 **
NEANT				

* *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 **
NEANT		

* *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	94,66	76,99
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	94,66	76,99

* *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. 422-1 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.		
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.		
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	31 147 057,07	44 466 238,87

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

	30/06/2022
Parts GROUPAMA FP FLEXIBLE ALLOCATION I	
Frais de gestion variables provisionnés	
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	
Frais de gestion variables acquis	68,89
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	
Parts GROUPAMA FP FLEXIBLE ALLOCATION N	
Frais de gestion variables provisionnés	
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	
Frais de gestion variables acquis	24,09
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.»

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 règlementation SFTR.

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2022 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
GROUPAMA ENTREPRISES IC	EUR	5 512,5497	12 385 210,79	5,99
GROUPAMA MONETAIRE IC	EUR	106,787	22 607 559,68	10,93
GROUPAMA TRESORERIE IC	EUR	906,5135	36 036 848,73	17,41
TOTAL FRANCE			**71 029 619,20**	**34,33**
IRLANDE				
LORD ABBETT SHORT DURATION INCOME FUND	USD	2 130 000	23 165 239,85	11,19
SOURCE S&P 500 UCITS ETF	USD	15 420	10 607 629,59	5,13
TOTAL IRLANDE			**33 772 869,44**	**16,32**
LUXEMBOURG				
AGIF ALLIANZ VOLATILITY STRATEGY FUND IT	EUR	6 400	6 341 120,00	3,06
Allianz Global Investors Fund - Allianz Credit Opportunities	EUR	23 140	23 285 087,80	11,25
AMUNDI MSCI EURO QUALITYFACTR UCETFEUR C	EUR	44 354	3 805 249,42	1,84
DNCA INVEST- ALP BONDS-SIEUR	EUR	75 000	8 160 750,00	3,94
EXANE FUNDS 2 EQ SEL EUR-S	EUR	1 061	14 526 660,28	7,02
EXANE FUNDS 2 SICAV EXANE PLEIADE FUND S EUR CAP	EUR	1 090	12 339 334,10	5,97
GARTMORE-UK ABS RET-I	EUR	1 434 000	10 420 161,00	5,04
G FUND - SHORT TERM ABS RETURN SI SC EUR	EUR	2 000	1 941 360,00	0,94
JANUS HENDERSON HORIZON FUND SICAV - EURO HIGH YIELD BOND GU	EUR	75 000	10 245 000,00	4,95
TOTAL LUXEMBOURG			**91 064 722,60**	**44,01**
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			**195 867 211,24**	**94,66**
TOTAL Organismes de placement collectif			**195 867 211,24**	**94,66**
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
DJE 600 EUROP 0922	EUR	-481	48 100,00	0,03
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			**48 100,00**	**0,03**
TOTAL Engagements à terme fermes			**48 100,00**	**0,03**
TOTAL Instrument financier à terme			**48 100,00**	**0,03**
Appel de marge				
APPEL MARGE JP MORGA	EUR	-48 100	-48 100,00	-0,03
TOTAL Appel de marge			**-48 100,00**	**-0,03**
Créances			**47 504 505,83**	**22,96**
Dettes			**-47 442 320,61**	**-22,93**

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2022 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Comptes financiers			**10 978 497,14**	**5,31**
Actif net			**206 907 893,60**	**100,00**