30/12/2022

Fonds de droit français

GROUPAMA HORIZON OBLIGATIONS MONDE

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. 214-24-55 du code monétaire et financier.	
b) Avoirs bancaires	14 539 047,10
c) Autres actifs détenus par l'OPC	426 282 589,04
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	440 821 636,14
e) Passif	-381 440,01
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	440 440 196,13

*** 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 HORIZON OBLIGATIONS MONDE N	C	440 440 196,13	4 917 292,083	89,56

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 du fonds d'investissement à vocation générale.		
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4 ° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	96,47	96,39

* *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	96,47	96,39
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	96,47	96,39

* *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 du fonds d'investissement à vocation générale.		
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4 ° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	71 924 705,15	11 452 364,16

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*

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/12/2022 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				
G FUND CREDIT EURO ISR IC	EUR	1 109,086	13 941 421,75	3,17
GROUPAMA CREDIT EURO IC	EUR	73 976,0191	13 538 351,26	3,07
GROUPAMA ETAT EURO ISR ID	EUR	1 917,885	19 724 008,81	4,48
GROUPAMA ETAT MONDE I	EUR	177 086,2509	101 165 833,41	22,96
TOTAL FRANCE			**148 369 615,23**	**33,68**
IRLANDE				
iShares Global Corp Bond EUR Hedged UCITS ETF (Dist)	EUR	215 377	18 287 962,60	4,15
ISHS EURO HIGH YLD CORP BD UCITS EUR DIS	EUR	157 696	13 988 817,92	3,18
VANGUARD GLOBAL CREDIT BOND FUND INSTITUTIONAL EUR HEDGED AC	EUR	571 780,02	56 989 943,55	12,94
TOTAL IRLANDE			**89 266 724,07**	**20,27**
LUXEMBOURG				
AM IND BAR GL AGG 500M UC ETF DR EUR HDG	EUR	713 963	32 611 045,38	7,40
G FUND - GBL BREAKEVEN INFL IC EUR	EUR	10 374,232	10 090 185,53	2,29
G FUND - GLOBAL BONDS IC EUR	EUR	156 853,642	144 559 453,54	32,83
TOTAL LUXEMBOURG			**187 260 684,45**	**42,52**
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			**424 897 023,75**	**96,47**
TOTAL Organismes de placement collectif			**424 897 023,75**	**96,47**
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
US 10YR NOTE 0323	USD	48	-42 164,44	-0,01
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			**-42 164,44**	**-0,01**
TOTAL Engagements à terme fermes			**-42 164,44**	**-0,01**
TOTAL Instrument financier à terme			**-42 164,44**	**-0,01**
Appel de marge				
APPEL MARGE JP MORGA	USD	45 000,16	42 164,59	0,01
TOTAL Appel de marge			**42 164,59**	**0,01**
Créances			**1 343 400,70**	**0,31**
Dettes			**-332 951,13**	**-0,08**
Comptes financiers			**14 532 722,66**	**3,30**
Actif net			**440 440 196,13**	**100,00**