



30/09/2024

Fonds de droit français

**GROUPAMA EURO
CONVERTIBLE**

RAPPORT SEMESTRIEL

ÉTAT 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	376 411 859,37
b) Avoirs bancaires	3 873 769,48
c) Autres actifs détenus par l'OPC	35 881 626,78
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	416 167 255,63
e) Passif	-6 308 144,24
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	409 859 111,39

(*) Les montants sont signés

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

Part	Type de part	Actif net de la part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
GR EURO CONVERT GA en EUR	C / D / R	71 117 420,09	5 711,167	12 452,34
GR EURO CONVERT OSC en EUR	C	1 171,42	0,075	15 618,93
GR EURO CONVERT PC en EUR	C	29 589 015,07	27 506,1340	1 075,72
GR EURO CONVERT RC en EUR	C	486,89	1,000	486,89
GR EURO CONVERT ZD en EUR	D / R	236 521 258,74	73 730,8756	3 207,89
GROUPAMA CONVERTIBLES IC en EUR	C	6 436 892,06	4 311,8160	1 492,84
GROUPAMA CONVERTIBLES M en EUR	C	53 182 410,25	312 829,510	170,00
GROUPAMA CONVERTIBLES N en EUR	C	13 001 253,54	20 691,6601	628,33
GROUPAMA CONVERTIBLES RD en EUR	D / R	9 203,33	19,283	477,27

ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Éléments 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.	84,61	83,32
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.	7,23	7,12
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.	6,13	6,04

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

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

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

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
Euro	EUR	345 799 614,08	84,37	83,09
Dollar Us	USD	26 148 268,41	6,38	6,28
Livre Sterling	GBP	4 463 976,88	1,09	1,07
TOTAL		376 411 859,37	91,84	90,45

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

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

RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR

Pays	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
FRANCE	35,41	34,88
ALLEMAGNE	17,47	17,20
ESPAGNE	11,24	11,07
ITALIE	9,65	9,50
PAYS-BAS	7,33	7,22
SUISSE	2,98	2,94
BELGIQUE	2,62	2,58
ROYAUME-UNI	2,29	2,26
MEXIQUE	1,23	1,21
ETATS-UNIS	0,73	0,72
LUXEMBOURG	0,57	0,56
DANEMARK	0,24	0,24
AUTRICHE	0,07	0,07
TOTAL	91,84	90,45

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

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

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

Nature d'actifs	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	6,13	6,04
Autres OPC et fonds d'investissements		
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne		
Autres		
TOTAL	6,13	6,04

(*) 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 PÉRIODE 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.	94 423 085,87	102 846 427,23
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.	5 555 333,26	833 482,17
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.	44 225 983,67	46 400 238,11

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
Dividendes versés				
16/07/2024	GR EURO CONVERT GA	101,51		101,51
16/07/2024	GR EURO CONVERT ZD	14,21		14,21
16/07/2024	GROUPAMA CONVERTIBLES RD	4,47		4,47
Dividendes à verser				
	GR EURO CONVERT GA			
	GR EURO CONVERT ZD			
	GROUPAMA CONVERTIBLES RD			

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

	30/09/2024
<p>Part GR EURO CONVERT GA</p> <p>Frais de gestion variables provisionnés</p> <p>Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés</p> <p>Frais de gestion variables acquis</p> <p>Pourcentage de frais de gestion variables acquis</p>	
<p>Part GR EURO CONVERT OSC</p> <p>Frais de gestion variables provisionnés</p> <p>Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés</p> <p>Frais de gestion variables acquis</p> <p>Pourcentage de frais de gestion variables acquis</p>	
<p>Part GR EURO CONVERT PC</p> <p>Frais de gestion variables provisionnés</p> <p>Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés</p> <p>Frais de gestion variables acquis</p> <p>Pourcentage de frais de gestion variables acquis</p>	
<p>Part GR EURO CONVERT RC</p> <p>Frais de gestion variables provisionnés</p> <p>Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés</p> <p>Frais de gestion variables acquis</p> <p>Pourcentage de frais de gestion variables acquis</p>	
<p>Part GR EURO CONVERT ZD</p> <p>Frais de gestion variables provisionnés</p> <p>Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés</p> <p>Frais de gestion variables acquis</p> <p>Pourcentage de frais de gestion variables acquis</p>	
<p>Part GROUPAMA CONVERTIBLES IC</p> <p>Frais de gestion variables provisionnés</p> <p>Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés</p> <p>Frais de gestion variables acquis</p> <p>Pourcentage de frais de gestion variables acquis</p>	

30/09/2024

Part GROUPAMA CONVERTIBLES M Frais de gestion variables provisionnés Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés Frais de gestion variables acquis Pourcentage de frais de gestion variables acquis	
Part GROUPAMA CONVERTIBLES N Frais de gestion variables provisionnés Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés Frais de gestion variables acquis Pourcentage de frais de gestion variables acquis	
Part GROUPAMA CONVERTIBLES RD Frais de gestion variables provisionnés Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés Frais de gestion variables acquis Pourcentage de frais de gestion variables acquis	

TRANSPARENCE DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA RÉUTILISATION DES INSTRUMENTS FINANCIERS - RÈGLEMENT 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.

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ACTIONS ET VALEURS ASSIMILÉES			5 506 583,20	1,34
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			5 506 583,20	1,34
Composants automobiles			409 723,20	0,10
FORVIA	EUR	44 400	409 723,20	0,10
Pétrole et gaz			3 557 320,00	0,86
ENI SPA	EUR	260 000	3 557 320,00	0,86
Services liés aux technologies de l'information			1 539 540,00	0,38
THALES	EUR	10 800	1 539 540,00	0,38
OBLIGATIONS CONVERTIBLES EN ACTIONS			353 396 558,97	86,23
Obligations convertibles négociées sur un marché réglementé ou assimilé			353 396 558,97	86,23
Banques commerciales			14 842 235,00	3,62
BARCLAYS BK ZCP 24-01-25 CV	EUR	5 000 000	4 941 275,00	1,21
BNP PAR ZCP 13-05-25 CV	EUR	8 000 000	9 900 960,00	2,41
Boissons			8 991 194,77	2,19
DAVIDE CAMPARI MILANO 2.375% 17-01-29	EUR	4 000 000	3 945 617,72	0,96
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE 2.625% 24-02-26	EUR	5 000 000	5 045 577,05	1,23
Compagnies aériennes			7 152 637,16	1,75
AIR FR KLM 6.5% PERP CV	EUR	4 000 000	4 136 467,83	1,01
JET2 1.625% 10-06-26 CV	GBP	2 500 000	3 016 169,33	0,74
Composants automobiles			9 841 620,00	2,40
PIRELLI C ZCP 22-12-25 CV	EUR	9 500 000	9 841 620,00	2,40
Conglomérats industriels			11 866 328,78	2,90
RHEINMETALL AG 2.25% 07-02-30	EUR	7 100 000	11 866 328,78	2,90
Construction et ingénierie			549 341,57	0,13
SELINI 4.0% 30-05-28 CV	EUR	500 000	549 341,57	0,13
Courrier, fret aérien et logistique			5 862 489,84	1,43
DEUTSCHE POST AG 0.05% 30-06-25	EUR	6 000 000	5 862 489,84	1,43
Distribution de produits alimentaires de première nécessité			14 402 320,00	3,51
WORLDLINE ZCP 30-07-25 CV	EUR	80 000	8 949 280,00	2,18
WORLDLINE ZCP 30-07-26 CV	EUR	60 000	5 453 040,00	1,33
Divertissement			2 258 179,77	0,55
UBISOFT ENTERTAINMENT 2.875% 05-12-31	EUR	2 900 000	2 258 179,77	0,55
Electricité			5 336 740,00	1,30
NEOEN 2.0% 02-06-25 CV	EUR	65 000	3 121 625,00	0,76
VOLTALIA 1.0% 13-01-25 CV	EUR	70 000	2 215 115,00	0,54
Equipement et services pour l'énergie			7 513 966,91	1,83
SAIPEM 2.875% 11-09-29 CV	EUR	6 000 000	7 513 966,91	1,83

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Equipements électriques			25 901 277,55	6,32
SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.625% 28-06-31 CV	EUR	11 100 000	11 628 607,48	2,84
SCHNEIDER ELECTRIC SE 1.97% 27-11-30 CV	EUR	10 500 000	13 291 132,83	3,24
SGL CARBON AG 5.75% 21-09-27	EUR	1 000 000	981 537,24	0,24
Gestion et promotion immobilière			4 803 630,66	1,17
LEG PROPERTIES BV 1.0% 04-09-30	EUR	4 500 000	4 803 630,66	1,17
Gestion immobilière et développement			16 945 973,25	4,13
LEG IMMOBILIEN AG 0.4% 30-06-28	EUR	2 500 000	2 286 184,24	0,56
NEXITY 0.25% 02-03-25 CV	EUR	90 000	6 025 500,00	1,47
NEXITY 0.875% 19-04-28 CV	EUR	15 500	639 049,50	0,16
TAG IMMOBILIEN AG 0.625% 27-08-26	EUR	8 500 000	7 995 239,51	1,94
Hôtels, restaurants et loisirs			24 075 038,15	5,87
ACCOR 0.7% 07-12-27 CV	EUR	80 000	4 114 240,00	1,00
AMADEUS CM 1.5% 09-04-25 CV	EUR	9 000 000	11 187 748,03	2,73
SPIE 2.0% 17-01-28 DD	EUR	4 500 000	5 315 894,02	1,30
TUI AG 1.95% 26-07-31 CV	EUR	1 900 000	2 021 102,70	0,49
TUI AG 5.0% 16-04-28 CV	EUR	1 400 000	1 436 053,40	0,35
Industrie aérospatiale et défense			26 443 099,83	6,48
MTU AERO ENGINES 0.05% 18-03-27	EUR	10 000 000	9 816 012,33	2,39
SAFRAN ZCP 01-04-28 CV	EUR	75 000	16 627 087,50	4,09
Logiciels			26 046 100,07	6,35
FNAC DARTY 0.25% 23-03-27 CV	EUR	37 000	2 695 505,50	0,66
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROU 1.125% 18-05-28	EUR	4 000 000	4 053 392,72	0,99
NEXI ZCP 24-02-28 CV	EUR	10 000 000	8 704 400,00	2,12
ZALANDO SE 0.05% 06-08-25 CV	EUR	10 000 000	9 682 580,82	2,36
ZALANDO SE 0.625% 06-08-27 CV	EUR	1 000 000	910 221,03	0,22
Machines			2 240 196,23	0,55
DURR AG 0.75% 15-01-26 CV	EUR	2 300 000	2 240 196,23	0,55
Métaux et minerais			11 370 187,49	2,77
RAG STIFTUNG 1.875% 16-11-29	EUR	7 100 000	8 396 262,63	2,04
RAG STIFTUNG 2.25% 28-11-30 CV	EUR	2 500 000	2 973 924,86	0,73
Multi utilities			6 812 365,00	1,66
SELENA SARL ZCP 25-06-25 CV	EUR	70	6 812 365,00	1,66
Outils et services appliqués aux sciences biologiques			11 845 862,60	2,89
QIAGEN NV 2.5% 10-09-31 CV	USD	4 600 000	4 244 832,18	1,04
QIAGEN NV ZCP 17-12-27 CV	USD	9 000 000	7 601 030,42	1,85
Produits chimiques			7 741 440,00	1,89
UMICORE ZCP 23-06-25 CV	EUR	8 000 000	7 741 440,00	1,89
Semi-conducteurs et équipements pour fabrication			21 187 359,16	5,17
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES NV 1.875% 06-04-29	EUR	3 000 000	3 938 535,25	0,96
SOITEC ZCP 01-10-25 CV	EUR	30 000	5 032 830,00	1,23
STMICROELECTRONICS NV ZCP 04-08-27	USD	13 600 000	12 215 993,91	2,98

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Services aux collectivités			7 254 567,95	1,77
IBERDROLA FINANZAS SAU 0.8% 07-12-27 CV	EUR	6 500 000	7 254 567,95	1,77
Services aux entreprises			7 525 597,99	1,84
ELIS EX HOLDELIS 2.25% 22-09-29	EUR	4 000 000	5 178 965,75	1,27
LAGFIN SCA 3.5% 08-06-28 CV	EUR	2 500 000	2 346 632,24	0,57
Services clientèle divers			15 135 850,74	3,69
EDENRED ZCP 14-06-28 CV	EUR	123 000	7 204 171,50	1,76
JUST EAT TAKEAWAYCOM NV 0.625% 09-02-28	EUR	2 000 000	1 698 504,24	0,41
JUST EAT TAKEAWAYCOM NV ZCP 09-08-25	EUR	6 500 000	6 233 175,00	1,52
Services de télécommunication diversifiés			23 577 529,53	5,75
CELLNEX TELECOM 0.5% 05-07-28 CV	EUR	9 100 000	9 737 356,52	2,38
CELLNEX TELECOM 0.75% 20-11-31 CV	EUR	12 000 000	10 644 130,82	2,59
CELLNEX TELECOM 2.125% 11-08-30 CV	EUR	3 000 000	3 196 042,19	0,78
Services financiers diversifiés			18 807 695,68	4,59
CITIGROUP GLOBAL MKTS 1.0% 09-04-29 CV	EUR	3 000 000	2 983 174,52	0,73
GROUPE BRUXELLES LAMBERT 2.125% 29-11-25	EUR	3 000 000	3 002 227,54	0,73
MERRILL LYNCH BV ZCP 30-01-26	EUR	1 500 000	1 517 857,50	0,37
ORPAR 2.0% 07-02-31 CV	EUR	3 000 000	2 842 576,39	0,69
WENDEL 2.625% 27-03-26 CV	EUR	8 000 000	8 461 859,73	2,07
Services liés aux technologies de l'information			3 548 733,29	0,87
BECHTLE AG 2.0% 08-12-30 CV	EUR	3 500 000	3 548 733,29	0,87
Soins et autres services médicaux			3 517 000,00	0,86
CLARIANE 1.875% PERP CV	EUR	100 000	3 517 000,00	0,86
OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES			17 508 717,20	4,27
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			17 508 717,20	4,27
Automobiles			3 961 435,62	0,96
RENAULT 2.375% 25-05-26 EMTN	EUR	4 000 000	3 961 435,62	0,96
Banques commerciales			3 556 530,43	0,87
COMMERZBANK AKTIENGESELLSCHAFT 7.875% PERP	EUR	400 000	435 759,73	0,11
INTE 7.2% 28-11-33	USD	2 000 000	2 086 411,90	0,51
RCI BANQUE 5.5% 09-10-34 EMTN	EUR	1 000 000	1 034 358,80	0,25
Construction et ingénierie			3 344 320,12	0,82
WEBUILD 5.375% 20-06-29	EUR	3 200 000	3 344 320,12	0,82
Distribution de produits alimentaires de première nécessité			1 447 807,55	0,35
OCADO GROUP 10.5% 08-08-29	GBP	1 200 000	1 447 807,55	0,35
Electricité			2 784 108,79	0,68
EDF 7.5% PERP EMTN	EUR	2 400 000	2 784 108,79	0,68
Equipements et fournitures médicaux			999 034,02	0,24
GNDC 0 7/8 11/25/24	EUR	1 000 000	999 034,02	0,24
Gestion immobilière et développement			281 088,04	0,07
CA IMMOBILIEN ANLAGEN 1.875% 26-03-26	EUR	292 000	281 088,04	0,07

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Produits chimiques			1 134 392,63	0,28
KS AKTUELL AG 4.25% 19-06-29	EUR	1 100 000	1 134 392,63	0,28
TITRES D'OPC			25 119 720,99	6,13
OPCVM			25 119 720,99	6,13
Gestion collective			25 119 720,99	6,13
GROUPAMA ALPHA FIXED INCOME PLUS IC EUR	EUR	3 000,209	3 296 389,63	0,80
GROUPAMA EURO HIGH YIELD - SC EUR	EUR	1 999,568	2 717 632,86	0,66
GROUPAMA TRESORERIE - IC	EUR	449,5578	19 105 698,50	4,67
Total			401 531 580,36	97,97

(*) Le secteur d'activité représente l'activité principale de l'émetteur de l'instrument financier ; il est issu de sources fiables reconnues au plan international (GICS et NACE principalement).

Inventaire des opérations à terme de devises

Type d'opération	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)			
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)	
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)
A/EUR/GBP/20241114		-113 103,35	EUR	7 819 112,26	GBP	-7 932 215,61
A/EUR/JPY/20241114	13 287,95		EUR	577 057,14	JPY	-563 769,19
A/EUR/USD/20241114	203 585,03		EUR	22 514 413,40	USD	-22 310 828,37
V/EUR/CHF/20241114		-5 739,73	CHF	637 314,78	EUR	-643 054,51
V/EUR/SEK/20241114	5 320,59		SEK	530 363,30	EUR	-525 042,71
Total	222 193,57	-118 843,08		32 078 260,88		-31 974 910,39

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions exprimé dans la devise de comptabilisation.

Inventaire des instruments financiers à terme

Inventaire des instruments financiers à terme - actions

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
CAC 40 FUT 1024	-27		-40 635,00	-2 065 365,00
DJS BAS R FUT 1224	80	224 800,00		2 329 200,00
EURO STOXX 50 1224	10		-1 300,00	503 000,00
FTSE 100 FUT 1224	1		-1 394,15	99 615,41
Sous-total 1.		224 800,00	-43 329,15	866 450,41
2. Options				
DEUTSCHE POST NAMEN 12/2024 PUT 38	-600		-54 600,00	700 624,80
DEUTSCHE POST NAMEN 12/2024 PUT 38	-600		-55 200,00	707 823,00
DEUTSCHE POST NAMEN 12/2025 CALL 48	1 200	139 200,00		1 175 706,00
DEUTSCHE TELEKOM 03/2025 CALL 28	1 460	81 760,00		1 326 415,84
DEUTSCHE TELEKOM 03/2025 PUT 28	-730		-134 320,00	1 370 758,23
DJS REALESTATE INDEX 12/2024 PUT 140	-200		-40 000,00	552 201,60
ENI SPA 11/2024 CALL 14.5	-273		-19 451,25	-459 427,88
EURO STOXX 50 10/2024 CALL 4675	-125		-429 625,00	-5 681 761,31
EURO STOXX 50 10/2024 CALL 4850	-70		-127 960,00	-2 758 248,22
EURO STOXX 50 10/2024 PUT 4125	210	3 150,00		-105 009,45
EURO STOXX 50 10/2024 PUT 4425	-420		-13 440,00	546 049,14
EURO STOXX 50 10/2024 PUT 4575	-330		-17 160,00	759 068,31
EURO STOXX 50 10/2024 PUT 4725	210	21 630,00		-997 589,78
EURO STOXX 50 11/2024 PUT 4675	-660		-199 980,00	5 115 460,35
EURO STOXX 50 11/2024 PUT 4900	330	229 680,00		-5 544 498,96
SAINT-GOBAIN 12/2024 CALL 85	550	163 900,00		1 910 205,00
SAINT-GOBAIN 12/2024 CALL 92	-550		-54 450,00	-867 457,80
SAINT-GOBAIN 12/2024 PUT 76	-175		-33 425,00	371 826,00
SANOFI 11/2024 PUT 100	-150		-30 750,00	520 159,50
SANOFI 12/2026 CALL 110	300	265 800,00		1 441 629,00
SCHNEIDER ELECTR 12/2024 CALL 280	-100		-13 300,00	-240 924,00
SHELL PLC 12/2024 CALL 35	1 700	8 500,00		221 146,20
SHELL PLC 12/2024 PUT 32	-850		-243 100,00	2 025 498,15
THALES 12/2024 CALL 190	220	880,00		21 952,70
Sous-total 2.		914 500,00	-1 466 761,25	2 111 606,42
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total		1 139 300,00	-1 510 090,40	2 978 056,83

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - taux d'intérêts

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
EURO BUND 1224	94	157 550,00		12 682 480,00
EURO-OAT 1224	-97		-97 000,00	-12 303 480,00
US 10YR NOTE 1224	-1		-336,01	-102 397,97
Sous-total 1.		157 550,00	-97 336,01	276 602,03
2. Options				
CBOT US TRES NT 5A 10/2024 PUT 110.5	-75		-57 751,11	5 078 762,21
Sous-total 2.			-57 751,11	5 078 762,21
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total		157 550,00	-155 087,12	5 355 364,24

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - de change

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.				
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total				

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - sur risque de crédit

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.				
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total				

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - autres expositions

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.				
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total				

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme ou des opérations à terme de devises utilisés en couverture d'une catégorie de part

L'OPC sous revue n'est pas concerné par cette rubrique.

Synthèse de l'inventaire

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	401 531 580,36
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	103 350,49
Total instruments financiers à terme - actions	-370 790,40
Total instruments financiers à terme - taux	2 462,88
Total instruments financiers à terme - change	
Total instruments financiers à terme - crédit	
Total instruments financiers à terme - autres expositions	
Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises	
Autres actifs (+)	13 116 631,70
Autres passifs (-)	-4 524 123,64
Passifs de financement (-)	
Total = actif net	409 859 111,39

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part GR EURO CONVERT GA	EUR	5 711,167	12 452,34
Part GR EURO CONVERT OSC	EUR	0,075	15 618,93
Part GR EURO CONVERT PC	EUR	27 506,1340	1 075,72
Part GR EURO CONVERT RC	EUR	1,000	486,89
Part GR EURO CONVERT ZD	EUR	73 730,8756	3 207,89
Part GROUPAMA CONVERTIBLES IC	EUR	4 311,8160	1 492,84
Part GROUPAMA CONVERTIBLES M	EUR	312 829,510	170,00
Part GROUPAMA CONVERTIBLES N	EUR	20 691,6601	628,33
Part GROUPAMA CONVERTIBLES RD	EUR	19,283	477,27