



au 28 mars 2024

Fonds de droit français

RETRAITE PRUDENCE

RAPPORT SEMESTRIEL

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR

| Éléments 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 | 1 047 888,06 |
| c) Autres actifs détenus par l'OPC | 180 256 224,49 |
| d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c) | 181 304 112,55 |
| e) Passif | -89 139,34 |
| f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC) | 181 214 973,21 |

(*) 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 |
|---------------------------------|--------------|----------------------|--------------------------------|------------------------------------|
| RETRAITE PRUDENCE Part A en EUR | C | 73 865 702,17 | 812 369,427000 | 90,92 |
| RETRAITE PRUDENCE Part N en EUR | C | 107 349 271,04 | 634 609,240000 | 169,15 |

ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

| Éléments 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. 422-1 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> | | |
| <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> | | |
| <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> | 99,44 | 99,39 |

(*) 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 (**) |
|--------|--------|------------------|---------------------------|-----------------------------------|
| NEANT | | | | |

(*) 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 (**) |
|-------------|--------------------------------------|----------------------------------------------|
| NEANT | | |

(*) 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 | 99,44 | 99,39 |
| Autres OPC et fonds d'investissements | | |
| FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne | | |
| Autres | | |
| TOTAL | 99,44 | 99,39 |

(*) 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 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. | | |
| 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. | 21 354 929,40 | 8 579 964,63 |

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

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 économique (*) | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle | % Actif Net |
|----------------------------------------------------|--------|---------------------|-----------------------|--------------|
| TITRES D'OPC | | | 180 201 917,83 | 99,44 |
| OPCVM | | | 180 201 917,83 | 99,44 |
| Parts ou Actions | | | 180 201 917,83 | 99,44 |
| GROUPAMA SELECTION ISR PRUDENCE F | EUR | 1 825 199,20 82 | 180 201 917,83 | 99,44 |
| Total | | | 180 201 917,83 | 99,44 |

(*) Le secteur d'activité représente l'activité principale exercée par l'émetteur de l'instrument financier, et est issu du code NACE publié pour cet émetteur.

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 (*) |
| Total | | | | | | |

(*) 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 | | | | |
| Sous-total 1. | 0,00 | | | |
| 2. Options | | | | |
| Sous-total 2. | 0,00 | | | |
| 3. Swaps | | | | |
| Sous-total 3. | 0,00 | | | |
| 4. Autres instruments | | | | |
| Sous-total 4. | 0,00 | | | |
| Total | | | | |

(*) 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 | | | | |
| Sous-total 1. | 0,00 | | | |
| 2. Options | | | | |
| Sous-total 2. | 0,00 | | | |
| 3. Swaps | | | | |
| Sous-total 3. | 0,00 | | | |
| 4. Autres instruments | | | | |
| Sous-total 4. | 0,00 | | | |
| Total | | | | |

(*) 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. | 0,00 | | | |
| 2. Options | | | | |
| Sous-total 2. | 0,00 | | | |
| 3. Swaps | | | | |
| Sous-total 3. | 0,00 | | | |
| 4. Autres instruments | | | | |
| Sous-total 4. | 0,00 | | | |
| 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. | 0,00 | | | |
| 2. Options | | | | |
| Sous-total 2. | 0,00 | | | |
| 3. Swaps | | | | |
| Sous-total 3. | 0,00 | | | |
| 4. Autres instruments | | | | |
| Sous-total 4. | 0,00 | | | |
| 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. | 0,00 | | | |
| 2. Options | | | | |
| Sous-total 2. | 0,00 | | | |
| 3. Swaps | | | | |
| Sous-total 3. | 0,00 | | | |
| 4. Autres instruments | | | | |
| Sous-total 4. | 0,00 | | | |
| 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) | 180 201 917,83 |
| Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) : | |
| Total opérations à terme de devises | |
| Total instruments financiers à terme - actions | |
| Total instruments financiers à terme - taux | |
| 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 (+) | 1 102 194,72 |
| Autres passifs (-) | -89 139,34 |
| Passifs de financement (-) | |
| Total = actif net | 181 214 973,21 |

| Libellé de la part | Devise de la part | Nombre de parts | Valeur liquidative |
|-------------------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| Part RETRAITE PRUDENCE Part A | EUR | 812 369,427000 | 90,92 |
| Part RETRAITE PRUDENCE Part N | EUR | 634 609,240000 | 169,15 |