



31/03/2023

Fonds de droit français

**GROUPAMA SELECTION
ISR PRUDENCE**

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	
b) Avoirs bancaires	14 550 818,75
c) Autres actifs détenus par l'OPC	795 818 949,02
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	810 369 767,77
e) Passif	-5 787 879,81
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	804 581 887,96

* Les montants sont signés

NOMBRE D'ACTIONS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

Action	Type d'action	Actif net par action	Nombre d'actions en circulation	Valeur nette d'inventaire par action
GROUPAMA SELECTION ISR PRUDENCE E3 en EUR	C	856 192,29	8 428,796200	101,57
GROUPAMA SELECTION ISR PRUDENCE F en EUR	D et/ou R	220 919 109,91	2 384 718,583400	92,63
GROUPAMA SELECTION ISR PRUDENCE F2 en EUR	D et/ou R	376 768 864,28	4 078 656,3072	92,37
GROUPAMA SELECTION ISR PRUDENCE N en EUR	C	206 037 721,48	1 543 170,203100	133,51

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. 422-1 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>	98,02	97,32

* 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	96,55	95,86
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	1,47	1,46
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	98,02	97,32

* 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.		
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-I I du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	331 755 913,49	360 059 794,84

DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE

	Action	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt (1) EUR	Montant brut unitaire (2) EUR
Dividendes versés				
	GROUPAMA SELECTION ISR PRUDENCE F			
	GROUPAMA SELECTION ISR PRUDENCE F2			
Dividendes à verser				
	GROUPAMA SELECTION ISR PRUDENCE F			
	GROUPAMA SELECTION ISR PRUDENCE F2			

(1) Le crédit d'impôt unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

(2) Le montant brut unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

INFORMATIONS DIVERSES

Etablissement dépositaire : CACEIS BANK FRANCE - 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 AM - 25 rue de la Ville l'Evêque - 75008 - Paris

**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 31/03/2023 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 O	EUR	9 260,326	81 681 816,72	10,15
G FUND OPPORTUNITIES EUROPE part O	EUR	1 360,544	12 033 576,31	1,50
G FUND - WORLD VISION R O	EUR	731,264	11 898 286,85	1,48
GROUPAMA CREDIT EURO CT OC	EUR	2 021,421	23 237 144,03	2,89
Groupama Etat Euro Isr FCP	EUR	16 275,962	144 325 302,68	17,94
GROUPAMA EUROPE EQUITIES O	EUR	450,385	7 284 450,42	0,90
GROUPAMA MONETAIRE IC	EUR	582,203	124 390 215,18	15,46
GROUPAMA OBLIG EURO PART O	EUR	16 761,619	156 282 821,31	19,42
GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND IC	EUR	1 239,997	12 431 850,32	1,54
GROUPAMA US EQUITIES O	USD	4 089,97	66 615 972,23	8,28
SCOR EURO HIGH YIELD	EUR	800	1 495 392,00	0,19
TOTAL FRANCE			641 676 828,05	79,75
LUXEMBOURG				
AMD INDEX MSCI JPN SRI PAB UCITS ETF DR C	EUR	151 340	6 494 604,76	0,81
AMUNDI INDEX EURO AGG SRI - UCITS ETF DR C	EUR	1 574 136	66 042 403,64	8,20
AMUNDI INDEX MSCI PACIFIC EX JAPAN SRI - UCITS ETF DR - EUR	EUR	6 540	3 795 463,49	0,47
Amundi Index Solutions SICAV - Amundi Index S&P 500	EUR	267	28 374,68	
AMUNDI MSCI EMERGING ESG LEADERS - UCITS ETF DR C	EUR	75 340	3 604 491,62	0,45
G FUND-AVENIR EUROPE OD EUR	EUR	7 209,985	4 987 939,72	0,62
G FUND GBL INFL SHORT DURATION OCEUR	EUR	46 958,631	45 964 047,20	5,71
G FUND HIGH YIELD MATURITY 3 I ACC	EUR	1 850	1 893 567,50	0,24
G FUND TOT RET ALL CAP EUR OC	EUR	1 644,516	2 371 392,07	0,30
TOTAL LUXEMBOURG			135 182 284,68	16,80
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			776 859 112,73	96,55
Fonds professionnels à vocation générale et équival. d'autres Etats membres UE et organismes de titrisation cotés				
IRLANDE				
ISHARES MSCI USA VALUE FACTOR ESG UCITS ETF USD ACC	USD	2 731 672	11 817 508,00	1,47
TOTAL IRLANDE			11 817 508,00	1,47
TOTAL Fonds professionnels à vocation générale et équival. d'autres Etats membres UE et organismes de titrisation cotés			11 817 508,00	1,47
TOTAL Organismes de placement collectif			788 676 620,73	98,02

PORTEFEUILLE TITRES AU 31/03/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
EC EURUSD 0623	USD	-288	-800 387,73	-0,10
EURO SCHATZ 0623	EUR	-420	207 840,00	0,03
EURO STOXX 50 0623	EUR	-103	-228 145,00	-0,03
FGBL BUND 10A 0623	EUR	-477	-1 536 750,00	-0,19
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			-2 357 442,73	-0,29
TOTAL Engagements à terme fermes			-2 357 442,73	-0,29
TOTAL Instrument financier à terme			-2 357 442,73	-0,29
Appel de marge				
APPEL MARGE JP MORGA	EUR	1 557 055	1 557 055,00	0,19
APPEL MARGE JP MORGA	USD	869 581,25	800 387,73	0,10
TOTAL Appel de marge			2 357 442,73	0,29
Créances			4 577 045,56	0,57
Dettes			-1 522 756,40	-0,19
Comptes financiers			12 850 978,07	1,60
Actif net			804 581 887,96	100,00