



30/06/2023

Fonds de droit français

**GROUPAMA ETAT
MONDE**

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	107 714 893,43
b) Avoirs bancaires	2 468 723,47
c) Autres actifs détenus par l'OPC	72 034 211,59
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	182 217 828,49
e) Passif	-74 386 591,02
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	107 831 237,47

* 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 ETAT MONDE G en EUR	C/D/R	876,75	0,100000	8 767,50
GROUPAMA ETAT MONDE I en EUR	C	105 748 165,67	182 479,030600	579,50
GROUPAMA ETAT MONDE MC en EUR	C	88 328,61	702,121000	125,80
GROUPAMA ETAT MONDE MD en EUR	D/R	1 974 737,72	23 453,039	84,19
GROUPAMA ETAT MONDE N en EUR	C	19 128,72	34,797000	549,72

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-I 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>	37,46	22,17
<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>	62,44	36,95
<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>		

* 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 **
Euro	EUR	45 145 889,59	41,87	24,78
Dollar Us	USD	23 900 699,31	22,16	13,12
Yen Japonais	JPY	22 708 716,39	21,06	12,46
Livre Sterling	GBP	7 629 397,78	7,08	4,19
Dollar Canadien	CAD	3 355 902,72	3,11	1,84
Dollar Australien	AUD	1 834 061,19	1,70	1,01
Peso Mexicain	MXN	896 950,78	0,83	0,49
Baht Thaïlandais	THB	411 590,83	0,38	0,23
Nouveau Sheqel Israélien	ILS	376 294,67	0,35	0,21
Franc Suisse	CHF	346 012,89	0,32	0,19
Dollar de Singapour	SGD	269 068,99	0,25	0,15
Couronne Danoise	DKK	219 186,55	0,20	0,12
Zloty Polonais	PLN	218 438,51	0,20	0,12
Dollar Néo-Zélandais	NZD	150 217,85	0,14	0,08
Forint Hongrois	HUF	121 963,36	0,11	0,07
Couronne Norvégienne	NOK	77 434,36	0,07	0,04
Couronne Suédoise	SEK	53 067,66	0,05	0,03
TOTAL		107 714 893,43	99,89	59,11

* 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 **
ETATS-UNIS	22,16	13,12
JAPON	21,06	12,46
ALLEMAGNE	16,69	9,87
ROYAUME-UNI	7,08	4,19
FRANCE	5,28	3,12
ITALIE	4,89	2,89
ESPAGNE	3,76	2,22
CANADA	3,11	1,84
SAINT-MARIN	2,48	1,47
MEXIQUE	2,01	1,19
AUSTRALIE	1,70	1,01
BELGIQUE	1,59	0,94
GRECE	1,51	0,89
CHILI	1,39	0,82
PAYS-BAS	0,92	0,54
AUTRICHE	0,79	0,47
PORTUGAL	0,53	0,32
THAILANDE	0,38	0,23
ISRAEL	0,35	0,21
SUISSE	0,32	0,19
POLOGNE	0,28	0,17
IRLANDE	0,27	0,16
ROUMANIE	0,27	0,16
SINGAPOUR	0,25	0,15
DANEMARK	0,20	0,12
NOUVELLE-ZELANDE	0,14	0,08
FINLANDE	0,13	0,08

Pays	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
LUXEMBOURG	0,12	0,07
HONGRIE	0,11	0,07
NORVEGE	0,07	0,04
SUEDE	0,05	0,03
TOTAL	99,89	59,11

* 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		
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		

* 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.	110 728 595,43	101 132 657,97
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.	22 540 102,71	25 577 839,52
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.		

DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE

	Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
Dividendes versés				
17/04/2023	GROUPAMA ETAT MONDE G	163,40		163,40
17/04/2023	GROUPAMA ETAT MONDE MD	1,44		1,44
Dividendes à verser				
	GROUPAMA ETAT MONDE G			
	GROUPAMA ETAT MONDE MD			

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 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 30/06/2023 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
ALLEMAGNE 0.1% 15-04-26 IND	EUR	5 902 548,23	7 129 565,31	6,61
ALLEMAGNE 4.75% 07/40	EUR	127 800	167 377,10	0,16
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0.0% 15-02-32	EUR	879 470,96	719 618,32	0,67
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0.0% 15-08-31	EUR	503 400	416 593,70	0,39
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0.0% 15-08-50	EUR	343 400	184 852,22	0,17
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0.0% 15-08-52	EUR	505 100	259 353,70	0,24
BUNDSOBLIGATION 0.0% 11-04-25	EUR	1 094 800	1 035 494,68	0,96
BUNDSOBLIGATION 1.3% 15-10-27	EUR	3 378 450	3 242 239,23	3,00
BUNDSOBLIGATION 2.2% 13-04-28	EUR	3 759 400	3 731 851,02	3,46
GERMANY 5.5% 04-01-31	EUR	894 800	1 106 298,48	1,02
TOTAL ALLEMAGNE			17 993 243,76	16,68
AUSTRALIE				
AUSTRALIA 4.75% 04/27	AUD	536 000	338 851,23	0,31
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 1.75% 21-06-51	AUD	225 000	79 940,46	0,08
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 2.5% 21-05-30	AUD	861 000	480 305,58	0,45
AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 2.75% 21-11-28	AUD	472 000	272 232,37	0,25
AUSTRALIE 2.75% 21-06-35	AUD	157 000	83 875,83	0,07
AUSTRALIE 4.25% 21/04/2026	AUD	703 000	434 853,61	0,41
TREASURY CORP VICTORIA 4.25% 20/12/32	AUD	244 000	144 002,11	0,13
TOTAL AUSTRALIE			1 834 061,19	1,70
AUTRICHE				
ASFING I 1/2 09/15/30	EUR	300 000	273 609,00	0,25
AUST GOVE BON 1.5% 20-02-47	EUR	81 000	60 284,80	0,06
AUST GOVE BON 3.8% 26-01-62	EUR	100 000	118 594,34	0,10
AUST GOVE BON 4.15% 15-03-37	EUR	150 000	169 295,41	0,16
AUSTRIA GOVERNMENT BONDT 0.5% 20-04-27	EUR	250 000	228 101,15	0,21
TOTAL AUTRICHE			849 884,70	0,78
BELGIQUE				
BELGIQUE 4.25% 03/41	EUR	81 350	92 641,36	0,09
BELGIQUE 5%04-35 OLO	EUR	151 000	180 257,45	0,17
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.0% 22-10-31	EUR	350 500	275 377,34	0,26
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.65% 22-06-71	EUR	165 700	69 115,64	0,06
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 22-06-28	EUR	200 000	181 040,46	0,17
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.0% 22-06-26	EUR	300 000	282 893,36	0,26
BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.7% 22-06-50	EUR	206 500	147 008,87	0,13
COMMUNAUTE EUROPEAN BRU 0.0% 04-07-35	EUR	100 000	69 105,00	0,07
EUROPEAN UNION 0.4% 04-02-37	EUR	600 000	421 004,30	0,39
TOTAL BELGIQUE			1 718 443,78	1,60
CANADA				
CANADA 3.50% 12/45	CAD	325 000	236 992,18	0,22
CANADA GOVERNMENT 5.75% 01-06-33	CAD	115 000	96 408,08	0,09
CANADIAN GOVERNMENT BOND 0.25% 01-03-26	CAD	535 000	334 158,83	0,31
CANADIAN GOVERNMENT BOND 0.5% 01-11-23	CAD	1 515 000	1 035 408,70	0,96
CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.0% 01-09-26	CAD	474 000	300 650,92	0,28

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 01-03-25	CAD	852 000	561 313,16	0,52
CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.25% 01-06-30	CAD	966 000	582 147,35	0,54
CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 01-06-28	CAD	185 000	119 623,16	0,11
CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.0% 01-12-51	CAD	50 000	27 407,81	0,03
CANA GOVE 2.75% 01-12-64	CAD	97 000	61 792,53	0,05
TOTAL CANADA			3 355 902,72	3,11
CHILI				
CHILE GOVERNMENT INTL BOND 0.1% 26-01-27	EUR	1 225 000	1 071 140,76	1,00
CHILE GOVERNMENT INTL BOND 0.83% 02-07-31	EUR	300 000	235 795,61	0,22
REPU DU CHIL 1.625% 30-01-25	EUR	200 000	194 440,14	0,18
TOTAL CHILI			1 501 376,51	1,40
DANEMARK				
DENMARK 4.50% 15/11/2039	DKK	600 000	101 626,75	0,09
DENMARK GOVERNMENT BOND 0.5% 15-11-29	DKK	1 000 000	117 559,80	0,11
TOTAL DANEMARK			219 186,55	0,20
ESPAGNE				
ESPAGNE 1.95% 30-07-30	EUR	548 000	513 827,25	0,48
ESPAGNE 4.70% 30/07/41	EUR	200 000	234 720,41	0,22
ESPAGNE 5.15% 1028	EUR	250 000	281 709,90	0,26
ESPAGNE 5.75%01-32	EUR	238 000	296 172,94	0,27
SECRETARA GENERAL DEL TESORO 1.2% 31-10-40	EUR	150 000	103 709,65	0,10
SPAI GOVE BON 2.9% 31-10-46	EUR	150 000	132 863,28	0,12
SPAIN GOVERNMENT BOND 0.0% 31-01-27	EUR	1 038 000	924 058,74	0,86
SPAIN GOVERNMENT BOND 0.0% 31-01-28	EUR	300 000	259 194,00	0,24
SPAIN GOVERNMENT BOND 0.0% 31-05-24	EUR	500 000	483 865,00	0,45
SPAIN GOVERNMENT BOND 0.6% 31-10-29	EUR	300 000	256 966,15	0,24
SPAIN GOVERNMENT BOND 1.45% 31-10-71	EUR	65 000	32 182,97	0,03
SPAIN GOVERNMENT BOND 2.35% 30-07-33	EUR	460 000	429 799,17	0,40
SPGB 1 10/31/50	EUR	185 000	100 419,80	0,09
TOTAL ESPAGNE			4 049 489,26	3,76
ETATS-UNIS				
UNITED STATES OF AMERICA 2.875% 15-08-455	USD	1 119 900	858 422,28	0,80
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 0.375% 31-01-26	USD	391 600	322 797,19	0,30
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 0.5% 31-05-27	USD	261 900	207 587,75	0,19
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 0.625% 31-12-27	USD	1 708 500	1 338 269,07	1,25
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 0.75% 31-08-26	USD	5 628 900	4 615 066,25	4,28
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 1.125% 15-02-31	USD	392 300	297 295,33	0,28
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 1.125% 15-05-40	USD	1 613 400	961 145,66	0,89
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 1.25% 15-05-50	USD	1 209 800	625 596,78	0,58
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 1.375% 15-08-50	USD	1 410 200	758 291,70	0,71
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 1.875% 15-02-51	USD	1 985 000	1 218 378,42	1,13
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 2.375% 15-02-42	USD	1 137 100	821 092,37	0,76
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 2.375% 15-05-29	USD	543 900	456 059,59	0,42
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 2.75% 31-05-29	USD	224 700	192 275,96	0,18
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 2.75% 31-07-27	USD	2 987 500	2 613 536,54	2,42
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 2.875% 15-05-32	USD	789 800	674 094,03	0,62
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 2.875% 15-05-49	USD	1 199 100	913 017,52	0,85
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 2.875% 31-05-25	USD	343 800	304 073,04	0,28

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 4.5% 15-02-36	USD	270 300	271 438,36	0,25
UNIT STAT DEP 2.375% 15-08-24	USD	1 345 900	1 204 998,54	1,12
UNIT STAT DEP 3.125% 15-08-44	USD	981 300	789 018,25	0,73
UNIT STAT TRE 2.25% 15-11-25	USD	3 243 200	2 817 172,31	2,61
US TREASURY 4,375% 15/02/2038	USD	101 600	100 659,26	0,09
US TREASURY 5.375% 15/02/2031	USD	726 600	740 619,40	0,69
US TREASURY 5.5% 15/08/2028	USD	807 800	799 793,71	0,74
TOTAL ETATS-UNIS			23 900 699,31	22,17
FINLANDE				
FINLAND GOVERNMENT BOND 0.125% 15-04-36	EUR	48 000	33 134,55	0,03
FINLAND GOVERNMENT BOND 0.125% 15-04-52	EUR	100 000	47 150,32	0,04
FINLAND GOVERNMENT BOND 0.125% 15-09-31	EUR	77 000	61 509,91	0,06
TOTAL FINLANDE			141 794,78	0,13
FRANCE				
E.ETAT 4%05-55 OAT	EUR	136 805	157 658,22	0,15
E.ETAT 6%94-25 OAT	EUR	765 500	844 350,07	0,78
FRANCE 3.25% 25/05/2045	EUR	250 000	251 755,45	0,23
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.0% 25-11-29	EUR	297 327	248 714,04	0,23
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.5% 25-05-40	EUR	814 500	532 484,63	0,49
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.75% 25-05-52	EUR	169 000	92 300,98	0,09
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.25% 25-05-34	EUR	345 500	290 705,81	0,27
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.0% 25-02-27	EUR	1 181 220	1 061 267,11	0,98
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.0% 25-05-32	EUR	681 100	529 582,49	0,49
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.5% 25-05-72	EUR	218 700	86 280,75	0,08
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.75% 25-05-53	EUR	50 000	26 681,48	0,03
FRAN GOVE BON 1.5% 25-05-31	EUR	670 500	610 147,86	0,57
OAT 4% 25/04/60	EUR	60 000	70 151,42	0,06
RATP 0.35% 20-06-29 EMTN	EUR	800 000	674 203,10	0,62
SYNDICAT TRANSPORTS ILE DE FRANCE STIF 0.675% 24-11-36	EUR	300 000	212 278,64	0,20
TOTAL FRANCE			5 688 562,05	5,27
GRECE				
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 4.25% 15-06-33	EUR	1 544 000	1 623 479,38	1,50
TOTAL GRECE			1 623 479,38	1,50
HONGRIE				
HUNGARY 6.75% 22-10-28	HUF	45 200 000	121 963,36	0,11
TOTAL HONGRIE			121 963,36	0,11
IRLANDE				
IRELAND GOVERNMENT BOND 0.0% 18-10-31	EUR	113 000	89 979,64	0,09
IRELAND GOVERNMENT BOND 1.1% 15-05-29	EUR	83 000	75 453,87	0,07
IRISH 1.7 05/15/37	EUR	74 000	62 670,04	0,06
IRLANDE 2.0% 18-02-45	EUR	72 000	59 309,43	0,05
TOTAL IRLANDE			287 412,98	0,27
ISRAEL				
ETAT DISRAEL 1.75% 31-08-25	ILS	1 098 726	261 670,04	0,24
ISRAEL GOVERNMENT BOND FIXED 2.25% 28-09-28	ILS	500 000	114 624,63	0,10
TOTAL ISRAEL			376 294,67	0,34

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ITALIE				
ITAL BUON POL 2.8% 01-03-67	EUR	74 000	53 709,26	0,05
ITALIE 4.50% 01/03/26	EUR	736 000	760 821,84	0,71
ITALY 2.0% 01-12-25	EUR	245 000	235 673,65	0,22
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.95% 01-03-37	EUR	437 000	296 053,04	0,28
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.95% 01-06-32	EUR	580 000	453 384,00	0,42
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.35% 01-04-30	EUR	546 000	469 301,86	0,44
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.2% 01-06-27	EUR	607 000	575 784,18	0,54
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.65% 01-12-27	EUR	389 000	373 311,37	0,35
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.8% 15-06-29	EUR	962 000	913 884,18	0,84
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.1% 01-03-40	EUR	487 000	426 524,29	0,39
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.35% 01-03-35	EUR	293 000	275 566,23	0,25
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.85% 01-09-49	EUR	460 000	435 618,83	0,40
TOTAL ITALIE			5 269 632,73	4,89
JAPON				
JAPAN10 YEAR ISSUE 0.1% 20-06-28	JPY	71 550 000	454 563,84	0,42
JAPAN10 YEAR ISSUE 0.1% 20-06-31	JPY	240 450 000	1 504 580,49	1,40
JAPAN 2.1% 20-03-27	JPY	471 200 000	3 244 054,03	3,01
JAPAN 2.10% 12/29	JPY	107 550 000	768 169,28	0,71
JAPAN 2.3% 20/06/35	JPY	109 300 000	832 957,80	0,77
JAPAN 20 YEAR ISSUE 0.3% 20-06-39	JPY	105 700 000	618 360,69	0,57
JAPAN 20 YEAR ISSUE 0.7% 20-03-37	JPY	106 400 000	678 580,87	0,63
JAPAN 30 YEAR ISSUE 0.4% 20-09-49	JPY	118 800 000	616 982,86	0,57
JAPAN 30 YEAR ISSUE 0.5% 20-09-46	JPY	81 250 000	453 967,92	0,42
JAPAN 30 YEAR ISSUE 0.7% 20-12-48	JPY	70 550 000	401 210,94	0,37
JAPAN 30 YEAR ISSUE 0.8% 20-03-47	JPY	87 550 000	521 375,69	0,49
JAPAN 30 YEAR ISSUE 1.4% 20-12-45	JPY	110 000 000	742 955,99	0,68
JAPAN 30 YEAR ISSUE 1.7% 20-06-33	JPY	56 450 000	402 780,31	0,38
JAPAN 40 YEAR ISSUE 0.7% 20-03-61	JPY	41 550 000	214 620,70	0,20
JAPAN5 YEAR ISSUE 0.005% 20-03-26	JPY	327 050 000	2 078 763,53	1,92
JAPA YEAR ISS 0.4% 20-09-25	JPY	235 300 000	1 510 126,89	1,40
JAPON 0.6% 20-06-24	JPY	407 200 000	2 600 851,84	2,41
JAPON 1.2% 20-12-34	JPY	143 300 000	976 720,42	0,91
JAPON 1.6% 03/20/32	JPY	80 350 000	568 108,89	0,53
JAPON 1.7% 20-03-54	JPY	72 900 000	515 483,91	0,48
JAPON 1.80% 03/43	JPY	97 700 000	711 335,84	0,66
JAPON 2.10% 03/29	JPY	150 550 000	1 069 435,89	0,99
JAPON 2.2% 03/20/51	JPY	156 500 000	1 222 727,77	1,14
TOTAL JAPON			22 708 716,39	21,06
LUXEMBOURG				
LUXEMBOURG GOVERNMENT BOND 0.625% 01-02-27	EUR	146 000	133 283,38	0,12
TOTAL LUXEMBOURG			133 283,38	0,12
MEXIQUE				
ETAT DU MEXI 3.375% 23-02-31	EUR	200 000	189 030,60	0,18
MEXICAN BONOS 5.75% 05-03-26	MXN	180 500	896 950,78	0,83
MEXICO GOVERNMENT INTL BOND 1.125% 17-01-30	EUR	1 300 000	1 080 427,51	1,00
TOTAL MEXIQUE			2 166 408,89	2,01

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
NORVEGE				
NORWAY GOVERNMENT BOND 1.75% 06-09-29	NOK	1 000 000	77 434,36	0,07
TOTAL NORVEGE			77 434,36	0,07
NOUVELLE-ZELANDE				
NOUV 2.75% 15-04-37	NZD	164 000	73 811,35	0,07
NOUVELLEZELANDE 1.5% 15-05-31	NZD	170 000	76 406,50	0,07
TOTAL NOUVELLE-ZELANDE			150 217,85	0,14
PAYS-BAS				
NETHER 0 3/4 07/15/28	EUR	185 000	168 970,48	0,16
NETHER 2 3/4 01/15/47	EUR	170 000	175 606,30	0,16
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.0% 15-01-27	EUR	224 000	202 475,84	0,19
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.0% 15-01-52	EUR	75 000	36 583,50	0,03
NETHERLANDS GOVERNMENT 0.0% 15-07-31	EUR	116 500	94 236,85	0,09
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.0% 15-01-54	EUR	53 000	46 545,93	0,04
PAYS BAS 2.50% 15/01/2033	EUR	203 000	202 186,75	0,19
PAYS BAS 4% 15/01/37	EUR	53 300	61 579,10	0,05
TOTAL PAYS-BAS			988 184,75	0,91
POLOGNE				
POLAND GOVERNMENT BOND POLAND 2.5% 25-07-27	PLN	586 000	120 464,26	0,11
POLAND GOVERNMENT INTL BOND 1.0% 07-03-29	EUR	98 000	86 217,59	0,08
REPU DE POLO 2.75% 25-04-28	PLN	489 000	97 974,25	0,10
TOTAL POLOGNE			304 656,10	0,29
PORTUGAL				
PORTUGAL4.1%06-150437	EUR	80 000	86 288,14	0,08
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 0.9% 12-10-35	EUR	135 000	102 508,77	0,10
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 1.95% 15-06-29	EUR	175 000	165 592,40	0,15
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 4.125% 14-04-27	EUR	210 000	220 781,21	0,20
TOTAL PORTUGAL			575 170,52	0,53
ROUMANIE				
ROUMANIE 2.875% 26-05-28	EUR	327 000	293 702,74	0,28
TOTAL ROUMANIE			293 702,74	0,28
ROYAUME-UNI				
ANGLETERRE 4,75%04-38	GBP	343 000	412 217,26	0,38
ANGLETERRE 4.25% 07/09/2039	GBP	250 000	286 607,15	0,27
ANGLETERRE 4.25% 07/12/55	GBP	350 000	402 009,19	0,37
ROYAUME-UNI 4.5% 07/09/34	GBP	376 250	448 351,69	0,42
ROYAUMEUNI DE GB ET DIRLANDE DU NORD 3.5% 22-01-45	GBP	324 500	331 485,36	0,31
UKT I 3/4 09/07/37	GBP	200 000	167 929,01	0,15
UNITED KINGDOM 3.75% 22/07/2052	GBP	146 400	155 056,52	0,15
UNITED KINGDOM GILT 0.125% 31-01-24	GBP	1 672 900	1 894 127,33	1,76
UNITED KINGDOM GILT 0.5% 22-10-61	GBP	417 000	154 692,40	0,14
UNITED KINGDOM GILT 0.625% 07-06-25	GBP	202 900	216 671,14	0,20
UNITED KINGDOM GILT 0.875% 22-10-29	GBP	426 100	399 114,07	0,37
UNITED KINGDOM GILT 1.0% 31-01-32	GBP	440 700	392 712,42	0,36
UNITED KINGDOM GILT 1.25% 31-07-51	GBP	100 000	58 438,86	0,06

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
UNITED KINGDOM GILT 1.625% 22-10-71	GBP	281 600	163 780,75	0,15
UNITED KINGDOM GILT 1.75% 22-01-49	GBP	202 000	141 201,44	0,13
UNITED KINGDOM GILT 4.25% 07-12-27	GBP	467 000	532 781,68	0,49
UNITED KINGDOM GILT 4.25% 07-12-40	GBP	123 650	140 028,47	0,13
UNITED KINGDOM GILT 4.5% 07-12-42	GBP	150 000	175 213,55	0,16
UNITED KINGDOM GILT 4.75% 07-12-30	GBP	430 000	514 098,07	0,48
UNIT KING GIL 1.5% 22-07-26	GBP	608 000	642 881,42	0,60
TOTAL ROYAUME-UNI			7 629 397,78	7,08
SAINT-MARIN				
SAN MARINO GOVERNMENT BOND 6.5% 19-01-27	EUR	2 662 000	2 676 552,57	2,48
TOTAL SAINT-MARIN			2 676 552,57	2,48
SINGAPOUR				
REPUBLIQUE DE SINGAFOR 2.25% 01-08-36	SGD	118 000	74 583,56	0,07
SIGB 2 3/4 03/01/46	SGD	105 000	74 503,76	0,07
SINGAPOUR 2.875% 01/09/30	SGD	178 000	119 981,67	0,11
TOTAL SINGAPOUR			269 068,99	0,25
SUEDE				
KINGDOM OF SWEDEN 3.5% 30-03-39	SEK	560 000	53 067,66	0,05
TOTAL SUEDE			53 067,66	0,05
SUISSE				
SWISS 4 01/06/49	CHF	42 000	73 960,01	0,07
SWIT GOVE BON 0.5% 27-05-30	CHF	274 000	272 052,88	0,25
TOTAL SUISSE			346 012,89	0,32
THAILANDE				
THAILAND GOVERNMENT BOND 2.0% 17-12-31	THB	4 835 000	120 810,11	0,12
THAILAND GOVERNMENT BOND 3.4% 17-06-36	THB	2 390 000	65 914,71	0,06
THAILAND GOVERNMENT BOND 4.0% 17-06-72	THB	2 898 000	80 186,56	0,08
THAILAND GOVERNMENT BOND 4.675% 29-06-44	THB	4 519 000	144 679,45	0,13
TOTAL THAILANDE			411 590,83	0,39
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			107 714 893,43	99,89
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			107 714 893,43	99,89
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
EURO BOBL 0923	EUR	-43	45 150,00	0,04
EURO BUND 0923	EUR	-41	9 450,00	
EURO SCHATZ 0923	EUR	78	780,00	
FV CBOT UST 5 0923	USD	-7	13 032,77	0,01
JAP GOVT 10 0923	JPY	-11	-46 040,37	-0,04
LIFFE LG GILT 0923	GBP	1	-128,18	
SHORT EUR-BTP 0923	EUR	-126	108 360,00	0,10
TU CBOT UST 2 0923	USD	-56	2 828,54	
US 10YR NOTE 0923	USD	27	-26 881,88	-0,02
US 10Y ULT 0923	USD	25	2 864,34	0,01
US TBOND 30 0923	USD	4	257,93	
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			109 673,15	0,10
TOTAL Engagements à terme fermes			109 673,15	0,10

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				
E6R/0.0/FIX/2.54	EUR	1 000 000	1 928,96	
E6R/0.0/FIX/2.738	EUR	1 000 000	-38 200,86	-0,03
FIX/2.936/E6R/0.0	EUR	2 500 000	-19 489,80	-0,02
FIX/3.13/E6R/0.0	EUR	2 500 000	23 229,80	0,02
TOTAL Swaps de taux			-32 531,90	-0,03
Swaps d'inflation				
SWAP INFL G.S.2.405	EUR	2 500 000	24 121,38	0,03
SWAP INFL G.S 2.918	EUR	2 500 000	14 722,90	0,01
SWP INF GOLDMA 2.399	EUR	16 000 000	45 486,40	0,04
TOTAL Swaps d'inflation			84 330,68	0,08
TOTAL Autres instruments financiers à terme			51 798,78	0,05
TOTAL Instrument financier à terme			161 471,93	0,15
Appel de marge				
APPEL MARGE CACEIS	USD	-0,03	-0,03	
APPEL MARGE JP MORGA	GBP	110	128,18	
APPEL MARGE JP MORGA	JPY	7 260 000	46 040,37	0,04
APPEL MARGE JP MORGA	EUR	-163 740,01	-163 740,01	-0,15
APPEL MARGE JP MORGA	USD	8 617,88	7 899,07	0,01
TOTAL Appel de marge			-109 672,42	-0,10
Créances			71 687 930,95	66,48
Dettes			-71 227 587,91	-66,05
Comptes financiers			-395 798,51	-0,37
Actif net			107 831 237,47	100,00