

Compartment :

GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS

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	
b) Avoirs bancaires	6 737 753,03
c) Autres actifs détenus par l'OPC	1 265 257 641,29
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	1 271 995 394,32
e) Passif	-5 276 307,10
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	1 266 719 087,22

(*) Les montants sont signés

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

Action	Type d'action	Actif net de l'action	Nombre d'actions en circulation	Valeur nette d'inventaire par action
GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS E en EUR	C	22,16	0,2000	110,80
GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS E1 en EUR	C	3 513 027,02	31 613,9306	111,12
GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS E2 en EUR	C	22,16	0,2000	110,80
GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS E3 en EUR	C	3 385 944,13	29 540,9022	114,61
GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS F en EUR	D	418 479 713,10	4 025 200,6348	103,96
GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS F2 en EUR	D	413 203 885,51	3 919 291,6070	105,42
GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS M en EUR	C	5 420 797,27	53 828,012	100,70
GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS N en EUR	C	422 715 675,87	1 011 081,9115	418,08

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>	98,90	98,49

(*) 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	98,90	98,49
Autres OPC et fonds d'investissements		
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne		
Autres		
TOTAL	98,90	98,49

(*) 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.	904 642 225,46	1 167 310 921,49

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Action	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
Dividendes versés				
30/01/2024	GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS F2	0,01	0,00	0,01
Dividendes à verser				
	GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS F2			

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

	28/03/2024
Action GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS E Commissions de garantie Frais de gestion fixes Pourcentage de frais de gestion fixes Frais de gestion variables provisionnés Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés Frais de gestion variables acquis Pourcentage de frais de gestion variables acquis Rétrocessions des frais de gestion	
Action GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS E1 Commissions de garantie Frais de gestion fixes Pourcentage de frais de gestion fixes Frais de gestion variables provisionnés Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés Frais de gestion variables acquis Pourcentage de frais de gestion variables acquis Rétrocessions des frais de gestion	11 293,65 1,85
Action GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS E2 Commissions de garantie Frais de gestion fixes Pourcentage de frais de gestion fixes Frais de gestion variables provisionnés Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés Frais de gestion variables acquis Pourcentage de frais de gestion variables acquis Rétrocessions des frais de gestion	
Action GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS E3 Commissions de garantie Frais de gestion fixes Pourcentage de frais de gestion fixes Frais de gestion variables provisionnés Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés Frais de gestion variables acquis Pourcentage de frais de gestion variables acquis Rétrocessions des frais de gestion	4 905,82 0,36 827,97 0,03 4,41

28/03/2024

Action GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS F Commissions de garantie Frais de gestion fixes Pourcentage de frais de gestion fixes Frais de gestion variables provisionnés Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés Frais de gestion variables acquis Pourcentage de frais de gestion variables acquis Rétrocessions des frais de gestion	 1 684 847,89 0,90
Action GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS F2 Commissions de garantie Frais de gestion fixes Pourcentage de frais de gestion fixes Frais de gestion variables provisionnés Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés Frais de gestion variables acquis Pourcentage de frais de gestion variables acquis Rétrocessions des frais de gestion	 358 231,01 0,18
Action GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS M Commissions de garantie Frais de gestion fixes Pourcentage de frais de gestion fixes Frais de gestion variables provisionnés Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés Frais de gestion variables acquis Pourcentage de frais de gestion variables acquis Rétrocessions des frais de gestion	 17 500,76 0,75 1 834,59 0,04 8,83
Action GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS N Commissions de garantie Frais de gestion fixes Pourcentage de frais de gestion fixes Frais de gestion variables provisionnés Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés Frais de gestion variables acquis Pourcentage de frais de gestion variables acquis Rétrocessions des frais de gestion	 3 689 576,40 1,50

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			1 252 790 799,96	98,90
OPCVM			1 252 790 799,96	98,90
Parts ou Actions			1 252 790 799,96	98,90
AMERI-GAN OAC	EUR	13 128	148 940 442,00	11,76
AMUNDI INDEX EURO AGG SRI - UCITS ETF DR C	EUR	1 521 482	66 660 995,16	5,26
AMUNDI INDEX MSCI PACIFIC EX JAPAN SRI - UCITS ETF DR - EUR	EUR	30 489	18 261 325,57	1,44
Amundi SP 500 ESG UCITS ETF Acc	EUR	938 850	130 361 294,09	10,29
BNP PARIBAS EASY EURO HIGH YIELD SRI FOSSIL FREE UCITS ETF E	EUR	3 093 864	31 095 498,90	2,45
BNP Paribas Easy MSCI Japan ESG Filtered Min TE UCITS ETF Ca	EUR	1 280 146	19 315 354,91	1,52
CS ETF (IE) ON MSCI CANADA	CAD	122 168	21 603 632,41	1,71
G FUND-AVENIR EUROPE OD EUR	EUR	36 778,077	24 754 588,07	1,95
G FUND CREDIT EURO ISR OA	EUR	10 715	108 625 134,05	8,58
G FUND - EURO HIGH YIELD BONDS OD EUR	EUR	5 333	5 336 093,14	0,42
G FUND GBL INFL SHORT DURATION OCEUR	EUR	18 158,874	18 202 455,30	1,44
G FUND HIGH YIELD MATURITY 3 I ACC	EUR	2 412	2 711 449,80	0,21
G FUND OPPORTUNITIES EUROPE OA	EUR	2 544,864	24 175 215,50	1,91
G FUND TOT RET ALL CAP EUR OC	EUR	12 579,212	20 878 095,53	1,65
G FUND - WORLD REVOLUTIONS OC EUR	EUR	12 680,893	27 076 623,16	2,14
GROUPAMA CREDIT EURO CT OAC	EUR	3 452	34 977 113,84	2,76
GROUPAMA ETAT EURO ISR OA	EUR	12 294	122 764 564,62	9,69
GROUPAMA EUROPE EQUITIES Part OA	EUR	2 959	33 998 732,46	2,68
GROUPAMA OBLIG EURO OA	EUR	16 266	163 246 877,28	12,90
GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND IC	EUR	1 834,068	19 180 994,94	1,51
GROUPAMA US EQUITIES Part OA (C - USD)	USD	12 273	125 115 507,56	9,88
iShares EURO Corp Bond SRI UCITS ETF EUR (Dist)	EUR	1 594 500	7 510 095,00	0,59
iShares EURO High Yield Corp Bond ESG UCITS ETF EUR Acc	EUR	10 341 074	53 546 081,17	4,23
ISHARES PROP EURO	EUR	414 600	11 865 852,00	0,94
ISHARES SP 500 HEALTH CARE	USD	359 100	3 844 564,50	0,30
SCHELCHER OPTIMAL INCOME ESG C	EUR	3 770	6 387 134,00	0,50
SCOR EURO HIGH YIELD	EUR	1 150	2 355 085,00	0,19
Total			1 252 790 799,96	98,90

(*) 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 (*)
V/EUR/USD/20240411	345 111,03		USD	36 111 111,11	EUR	-35 766 000,08
Total	345 111,03			36 111 111,11		-35 766 000,08

(*) 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				
DJE 600 EUROP 0624	124	51 460,00		3 166 960,00
SP 500 MINI 0624	78	417 263,89		19 169 583,33
Sous-total 1.		468 723,89		22 336 543,33
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total		468 723,89		22 336 543,33

(*) 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 0624	95	7 600,00		12 671 100,00
Sous-total 1.		7 600,00		12 671 100,00
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total		7 600,00		12 671 100,00

(*) 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				
EC EURUSD 0624	-393	657 274,31		-49 222 795,14
Sous-total 1.		657 274,31		-49 222 795,14
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total		657 274,31		-49 222 795,14

(*) 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				
DJE 600 OIL G 0624	676	615 160,00		12 303 200,00
NQ USA NASDAQ 0624	142	458 573,15		48 582 407,41
ONK TOKYO NIK 0624	117	390 877,84		28 796 788,79
Sous-total 1.		1 464 610,99		89 682 396,20
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total		1 464 610,99		89 682 396,20

(*) 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 d'action

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)	1 252 790 799,96
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	345 111,03
Total instruments financiers à terme - actions	468 723,89
Total instruments financiers à terme - taux	7 600,00
Total instruments financiers à terme - change	657 274,31
Total instruments financiers à terme - crédit	
Total instruments financiers à terme - autres expositions	1 464 610,99
Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises	
Autres actifs (+)	16 261 274,14
Autres passifs (-)	-5 276 307,10
Passifs de financement (-)	
Total = actif net	1 266 719 087,22

Libellé de l'action	Devise de l'action	Nombre d'actions	Valeur liquidative
Action GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS E	EUR	0,2000	110,80
Action GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS E1	EUR	31 613,9306	111,12
Action GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS E2	EUR	0,2000	110,80
Action GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS E3	EUR	29 540,9022	114,61
Action GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS F	EUR	4 025 200,6348	103,96
Action GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS F2	EUR	3 919 291,6070	105,42
Action GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS M	EUR	53 828,012	100,70
Action GROUPAMA SELECTION ISR CONVICTIONS N	EUR	1 011 081,9115	418,08