



BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR

Informations semestrielles Juin 2023

OPCVM de BFT Investment Managers

Société de gestion : BFT Investment Managers

Sous déléguataire de gestion comptable en titre : CACEIS FUND ADMINISTRATION FRANCE

Dépositaire : CACEIS BANK

Commissaire aux comptes : PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT

Le document périodique ne fait pas l'objet d'une certification par le Commissaire aux comptes de l'OPC.

OPCVM BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR

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	39 096 811,77
b) Avoirs bancaires	598 220,10
c) Autres actifs détenus par l'OPC	3 781 839,56
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	43 476 871,43
e) Passif	-762 124,95
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	42 714 746,48

* 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
BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR - I (C) en EUR	C	25 394 536,01	264,575	95 982,37
BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR - I2 (C) en EUR	C	16 466 394,02	1 762,787	9 341,11
BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR - P (C) en EUR	C	853 816,45	9 219,814	92,60

OPCVM BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR

Eléments du portefeuille titres

Eléments 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.	77,21	75,85
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.	14,32	14,07
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.	8,63	8,48

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

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

OPCVM BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR

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	39 096 811,77	91,53	89,93
TOTAL		39 096 811,77	91,53	89,93

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

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

OPCVM BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR

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	25,12	24,68
ALLEMAGNE	11,76	11,55
PAYS-BAS	8,96	8,80
ITALIE	8,75	8,60
ESPAGNE	8,46	8,32
ROYAUME-UNI	6,21	6,10
ETATS-UNIS	5,86	5,75
LUXEMBOURG	2,96	2,91
SUEDE	2,51	2,46
BELGIQUE	1,85	1,82
DANEMARK	1,60	1,57
ISLE OF MAN	1,37	1,35
FINLANDE	1,16	1,14
IRLANDE	1,16	1,14
ROUMANIE	1,09	1,07
NORVEGE	0,90	0,89
JAPON	0,88	0,87
AUTRICHE	0,70	0,68
SLOVENIE	0,24	0,23
TOTAL	91,53	89,93

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

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

OPCVM BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR

Répartition 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	8,63	8,48
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	8,63	8,48

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

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

OPCVM BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR

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.	28 970 087,50	24 891 770,90
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.	5 585 966,80	4 019 834,00
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.	3 631 966,00	1 903 214,87

OPCVM BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR

Information sur les commissions de surperformance (En EUR)

	30/06/2023
Parts BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR - I (C)	
Frais de gestion variables provisionnés	
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés (1)	
Frais de gestion variables acquis (dus aux rachats)	
Pourcentage de frais de gestion variables acquis (dus aux rachats) (2)	

(1) par rapport à l'actif net de l'arrêté comptable.

(2) par rapport à l'actif net moyen.

OPCVM BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR

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.

OPCVM BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR

Portefeuille titres détaillé 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				
CHEPLAPHARM ARZNEIMITTEL GMBH 3.5% 11-02-27	EUR	300 000	277 295,86	0,65
CMZB 4.0% 23-03-26 EMTN	EUR	399 000	391 849,00	0,92
DEUTSCHE LUFTHANSA AG	EUR	300 000	286 440,01	0,67
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2.875% 16-05-27	EUR	400 000	370 480,17	0,87
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 0.25% 17-01-25	EUR	400 000	370 807,39	0,87
GRUENENTHAL 3.625% 15-11-26	EUR	100 000	94 755,18	0,22
HAMBURG COMMERCIAL BANK AG 4.875% 17-03-25	EUR	100 000	101 112,63	0,23
IHO VERWALTUNGS 3.75% 15-09-26	EUR	400 000	376 425,26	0,88
KION GROUP AG 1.625% 24-09-25	EUR	400 000	379 627,29	0,89
LBBW 2.875% 28-09-26	EUR	300 000	285 572,41	0,67
LBBW 3.625% 16-06-25 EMTN	EUR	200 000	193 290,47	0,45
PROGROUP AG 3.0% 31-03-26	EUR	400 000	378 970,55	0,89
SCHAEFFLER AG 2.75% 12-10-25	EUR	300 000	294 201,89	0,69
TECHEM VERWALTUNGSGESELLSCHAFT 675 MBH 2.0% 15-07-25	EUR	300 000	288 613,88	0,67
THY 2.5% 25-02-25 EMTN	EUR	100 000	98 569,31	0,23
THYSSENKRUPP AG 2.875% 22-02-24	EUR	200 000	199 957,88	0,47
VERTICAL MID 4.375% 15-07-27	EUR	300 000	275 176,79	0,65
ZF FINANCE 2.75% 25-05-27 EMTN	EUR	400 000	358 426,43	0,84
TOTAL ALLEMAGNE			5 021 572,40	11,76
AUTRICHE				
VILKSBANK WIEN AG 2.75% 06-10-27	EUR	300 000	297 329,62	0,70
TOTAL AUTRICHE			297 329,62	0,70
BELGIQUE				
ARGENTA SPAARBANK 1.0% 13-10-26	EUR	200 000	184 981,68	0,43
AZELIS FINANCE NV 5.75% 15-03-28	EUR	130 000	132 840,54	0,31
BELFIUS BANK 3.125% 11-05-26	EUR	400 000	383 440,69	0,90
ONTEX GROUP NV 3.5% 15-07-26	EUR	100 000	90 065,19	0,21
TOTAL BELGIQUE			791 328,10	1,85
DANEMARK				
GNDC 0 7/8 11/25/24	EUR	360 000	337 714,61	0,79
ORSTED 1.75% 09-12-19	EUR	400 000	345 072,43	0,81
TOTAL DANEMARK			682 787,04	1,60
ESPAGNE				
BANCO DE BADELL 1.125% 27-03-25	EUR	400 000	375 905,21	0,88
CELLNEX FINANCE 2.25% 12-04-26	EUR	500 000	471 834,51	1,11
GRIFOLS 1.625% 15-02-25	EUR	200 000	194 433,49	0,45
GRIFOLS 2.25% 15-11-27	EUR	200 000	182 366,88	0,42
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROU 0.5% 04-07-23	EUR	400 000	400 000,00	0,94
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROU 2.75% 25-03-25	EUR	400 000	388 687,89	0,91
LORCA TELECOM BONDCO SAU 4.0% 18-09-27	EUR	500 000	463 416,18	1,09

OPCVM BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR

Portefeuille titres détaillé au 30/06/2023 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
MERLIN PROPERTIES SOCIMI 2.375% 13-07-27	EUR	300 000	282 534,73	0,66
NH HOTELES GROUP 4.0% 02-07-26	EUR	500 000	478 263,11	1,12
VIA CELERE DERROLLOS INMOBILIARIOS 5.25% 01-04-26	EUR	400 000	377 843,72	0,88
TOTAL ESPAGNE			3 615 285,72	8,46
ETATS-UNIS				
BALL 0.875% 15-03-24	EUR	400 000	390 852,66	0,91
BELDEN CDT 3.375% 15-07-27	EUR	400 000	380 586,36	0,89
CELANESE US HOLDINGS LLC 4.777% 19-07-26	EUR	400 000	408 744,09	0,96
F 2.33 11/25/25	EUR	400 000	381 437,23	0,89
HARLEY DAVIDSON FINANCIAL SERVICE 5.125% 05-04-26	EUR	190 000	194 162,16	0,46
INTL FLAVORS FRAGRANCES 1.8% 25-09-26	EUR	100 000	91 387,00	0,22
IQVIA 1.75% 15-03-26	EUR	300 000	280 131,47	0,65
LEVI STRAUSS CO 3.375% 15-03-27	EUR	200 000	192 399,19	0,44
MPT OPERATING PARTNERSHIP LP MPT FINAN 3.325% 24-03-25	EUR	200 000	181 740,97	0,43
TOTAL ETATS-UNIS			2 501 441,13	5,85
FINLANDE				
HUHTAMAKI OY 4.25% 09-06-27	EUR	500 000	494 620,49	1,16
TOTAL FINLANDE			494 620,49	1,16
FRANCE				
ACCOR 2.5% 25-01-24	EUR	200 000	200 346,76	0,47
ACCOR 3.0% 04-02-26	EUR	200 000	195 840,35	0,46
AIR FR KLM 1.875% 16-01-25	EUR	500 000	474 129,13	1,11
ATOS SE 1.75% 07-05-25	EUR	500 000	426 546,75	1,00
AUCHAN 3.25% 23-07-27 EMTN	EUR	400 000	386 990,23	0,91
BANIJAY ENTERTAINMENT SASU 3.5% 01-03-25	EUR	200 000	198 322,64	0,46
BFCM BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL 1.625% 15-11-27	EUR	400 000	356 719,56	0,84
BUREAU VERITAS 1.875% 06-01-25	EUR	100 000	97 540,00	0,23
CROWN EU HLD 2.875% 01-02-26	EUR	400 000	390 286,85	0,91
ELIOR GROUP SCA 3.75% 15-07-26	EUR	200 000	169 449,89	0,39
ELIS EX HOLDELIS 1.0% 03-04-25	EUR	300 000	282 924,97	0,67
ELIS EX HOLDELIS 4.125% 24-05-27	EUR	100 000	99 149,52	0,23
ERAMET 5.875% 21-05-25	EUR	300 000	307 739,06	0,72
EUTELT 2.0% 02-10-25	EUR	500 000	461 176,83	1,08
FAURECIA 7.25% 15-06-26	EUR	500 000	522 966,23	1,22
FNAC DARTY 2.625% 30-05-26	EUR	300 000	288 220,85	0,67
GETLINK 3.5% 30-10-25	EUR	400 000	391 823,44	0,92
ILIAD 2.375% 17-06-26	EUR	300 000	278 567,11	0,65
KAPLA HOLDING 3.375% 15-12-26	EUR	400 000	365 385,24	0,86
LOUVRE BIDCO SAS E3R+6.5% 15-02-27	EUR	300 000	275 044,68	0,64
LOXAM SAS 2.875% 15-04-26	EUR	200 000	186 438,12	0,44
LOXAM SAS 3.25% 14-01-25	EUR	100 000	99 192,85	0,23
LOXAM SAS 5.75% 15-07-27	EUR	200 000	184 200,92	0,43
MERCIALYS 4.625% 07-07-27	EUR	500 000	491 263,59	1,15
PARTS EUROPE E3R+4.0% 20-07-27	EUR	500 000	509 822,66	1,19

OPCVM BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR

Portefeuille titres détaillé au 30/06/2023 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
PICARD GROUPE 3.875% 01-07-26	EUR	500 000	462 060,43	1,09
QUADIENT 2.25% 03-02-25	EUR	300 000	287 714,92	0,68
RCI BANQUE 0.5% 14-07-25 EMTN	EUR	80 000	74 455,91	0,18
RENAULT 1.25% 24-06-25 EMTN	EUR	400 000	375 327,63	0,88
SOCGEN 2 5/8 02/27/25	EUR	400 000	390 940,90	0,91
SPIE 2.625% 18-06-26	EUR	400 000	382 589,38	0,89
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	EUR	400 000	310 024,94	0,72
VALEO 1.5% 18-06-25 EMTN	EUR	100 000	94 918,91	0,22
VALEO 5.375% 28-05-27 EMTN	EUR	300 000	302 270,29	0,71
VALLOUREC 8.5% 30-06-26	EUR	400 000	407 818,64	0,95
TOTAL FRANCE			10 728 210,18	25,11
IRLANDE				
PERMANENT TSB GROUP 5.25% 30-06-25	EUR	500 000	496 140,59	1,17
TOTAL IRLANDE			496 140,59	1,17
ISLE OF MAN				
PLAYTECH 3.75% 12-10-23	EUR	500 000	190 251,90	0,45
PLAYTECH 4.25% 07-03-26	EUR	400 000	396 861,23	0,93
TOTAL ISLE OF MAN			587 113,13	1,38
ITALIE				
AMPLIFON 1.125% 13-02-27	EUR	400 000	361 973,03	0,84
BANCO BPM 1.75% 28-01-25 EMTN	EUR	400 000	384 366,74	0,90
DOBANK 3.375% 31-07-26	EUR	500 000	429 443,47	1,01
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE 1.875% 08-07-26	EUR	500 000	474 039,12	1,11
INTE 3.928% 15-09-26 EMTN	EUR	100 000	100 914,82	0,24
INTESA SANPAOLO SPA	EUR	250 000	258 570,33	0,61
LEONARDO 2.375% 08-01-26	EUR	400 000	384 033,38	0,90
NEXI 1.625% 30-04-26	EUR	500 000	458 293,54	1,08
SAIPEM FINANCE INTL BV 2.625% 07-01-25	EUR	300 000	294 603,32	0,69
UBI BANCA UNIONE DI BANCHE ITALIANE 5.875% PERP	EUR	200 000	189 693,75	0,44
WEBUILD 5.875% 15-12-25	EUR	300 000	305 825,29	0,71
WEBUILD SPA 1.75% 26-10-24	EUR	100 000	96 889,13	0,23
TOTAL ITALIE			3 738 645,92	8,76
JAPON				
NISSAN MOTOR 2.652% 17-03-26	EUR	400 000	377 645,06	0,88
TOTAL JAPON			377 645,06	0,88
LUXEMBOURG				
AEDAS HOMES OPCO SLU 4.0% 15-08-26	EUR	400 000	375 832,28	0,88
AROUNDTOWN 0.375% 15-04-27	EUR	300 000	216 183,41	0,51
HT TROPLAST 9.25% 15-07-25	EUR	300 000	318 746,82	0,75
INPOST 2.25% 15-07-27	EUR	400 000	352 386,12	0,82
TOTAL LUXEMBOURG			1 263 148,63	2,96
NORVEGE				
ADEVINTA A 2.625% 15-11-25	EUR	400 000	385 733,62	0,90
TOTAL NORVEGE			385 733,62	0,90

OPCVM BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR

Portefeuille titres détaillé au 30/06/2023 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
PAYS-BAS				
CONSTELLIUM SE 4.25% 15-02-26	EUR	400 000	397 755,24	0,93
CTP NV 0.625% 27-09-26 EMTN	EUR	300 000	243 840,21	0,57
CTP NV 0.875% 20-01-26 EMTN	EUR	370 000	317 262,66	0,74
DUFREY ONE BV 2.0% 15-02-27	EUR	500 000	441 118,64	1,03
IBERDROLA INTL BV 1.874% PERP	EUR	400 000	362 256,61	0,85
NE PROPERTY BV 1.875% 09-10-26	EUR	300 000	264 909,76	0,62
NIBC BANK NV 0.25% 09-09-26	EUR	200 000	169 558,91	0,40
OI EUROPEAN GROUP BV 2.875% 15-02-25	EUR	100 000	98 813,82	0,23
PPF ARENA 2.125% 31-01-25 EMTN	EUR	300 000	291 556,35	0,68
QPARK HOLDING I BV 1.5% 01-03-25	EUR	300 000	289 870,70	0,68
QPARK HOLDING I BV 2.0% 01-03-27	EUR	200 000	172 900,61	0,41
SM MTH AUTO GRP 1.8% 06-07-24	EUR	400 000	393 581,32	0,92
TENNET HOLDING BV 2.375% PERP	EUR	400 000	383 461,72	0,90
TOTAL PAYS-BAS			3 826 886,55	8,96
ROUMANIE				
GLOBALWORTH REAL ESTATE INVESTMENTS 2.95% 29-07-26	EUR	100 000	78 188,91	0,18
RCS RDS 2.5% 05-02-25	EUR	400 000	386 313,23	0,90
TOTAL ROUMANIE			464 502,14	1,08
ROYAUME-UNI				
AVIS BUDGET FINANCE 4.75% 30-01-26	EUR	200 000	201 131,32	0,47
AVIS BUDGET FINANCE PLC 4.5% 15-05-25	EUR	200 000	198 175,97	0,46
AVIS BUDG FIN 4.125% 15-11-24	EUR	100 000	99 960,45	0,23
INEOS QUATTRO FINANCE 1 3.75% 15-07-26	EUR	500 000	450 605,79	1,05
INTL GAME TECHNOLOGY 3.5% 15-06-26	EUR	400 000	387 736,04	0,91
JAGUAR LAND ROVER 5.875% 15-11-24	EUR	300 000	303 521,77	0,71
ROLLS ROYCE 0.875% 09-05-24	EUR	100 000	97 099,24	0,23
ROLLS ROYCE 4.625% 16-02-26	EUR	400 000	401 232,03	0,94
VICTORIA 3.625% 24-08-26	EUR	500 000	420 248,42	0,99
YULE CATTO AND 3.875% 01-07-25	EUR	100 000	92 739,27	0,22
TOTAL ROYAUME-UNI			2 652 450,30	6,21
SLOVENIE				
NOVA LJUBLJANSKA BANKA DD 7.125% 27-06-27	EUR	100 000	101 826,62	0,24
TOTAL SLOVENIE			101 826,62	0,24
SUEDE				
DOMETIC GROUP AB 3.0% 08-05-26	EUR	300 000	282 550,40	0,66
INTRUM AB 4.875% 15-08-25	EUR	400 000	335 342,54	0,78
VERISURE HOLDING AB 3.25% 15-02-27	EUR	500 000	452 251,59	1,06
TOTAL SUEDE			1 070 144,53	2,50
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			39 096 811,77	91,53
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			39 096 811,77	91,53

OPCVM BFT CREDIT HIGH YIELD SHORT TERM ISR

Portefeuille titres détaillé au 30/06/2023 en EUR (suite)

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				
BFT FRANCE MONETAIRE COURT TERME ISR ACTIONS I C	EUR	100	1 341 883,00	3,14
BFT RENDEMENT 2027 I C	EUR	2 300	2 344 470,96	5,49
TOTAL FRANCE			3 686 353,96	8,63
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			3 686 353,96	8,63
TOTAL Organismes de placement collectif			3 686 353,96	8,63
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
EURO BOBL 0923	EUR	-10	1 000,00	0,01
EURO SCHATZ 0923	EUR	-30	18 600,00	0,04
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			19 600,00	0,05
TOTAL Engagements à terme fermes			19 600,00	0,05
Autres instruments financiers à terme				
Credit Default Swap				
ITRAXX EUR XOVER S39	EUR	-1 500 000	-61 330,35	-0,15
TOTAL Credit Default Swap			-61 330,35	-0,15
TOTAL Autres instruments financiers à terme			-61 330,35	-0,15
TOTAL Instrument financier à terme			-41 730,35	-0,10
Appel de marge				
APPEL MARGE CACEIS	EUR	-19 600	-19 600,00	-0,04
TOTAL Appel de marge			-19 600,00	-0,04
Créances			75 885,60	0,17
Dettes			-681 190,34	-1,59
Comptes financiers			598 215,84	1,40
Actif net			42 714 746,48	100,00



BFT Investment Managers

Société Anonyme au capital de 1 600 000 euros

Société de gestion de portefeuille agréée par l'AMF n°GP 98 026

Siège social : 90, boulevard Pasteur 75015 Paris - France - 334 316 965 RCS Paris