



# BFT EURO FUTUR ISR

## Informations semestrielles Février 2024

### 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 :** DELOITTE & ASSOCIÉS

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

# OPCVM BFT EURO FUTUR 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	35 443 719,88
b) Avoirs bancaires	126 520,62
c) Autres actifs détenus par l'OPC	980 398,67
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	36 550 639,17
e) Passif	-212 911,25
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	36 337 727,92

\* 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 EURO FUTUR ISR I-C en EUR	C	1 569 996,30	648,7195	2 420,14
BFT EURO FUTUR ISR I-D en EUR	D	195 308,93	136,2104	1 433,87
BFT EURO FUTUR ISR N-C en EUR	C	1 016 574,60	10,000	101 657,46
BFT EURO FUTUR ISR O-C en EUR	C	32 965 505,39	28 476,715	1 157,63
BFT EURO FUTUR ISR P-C en EUR	C	590 342,70	5 201,1730	113,50

# OPCVM BFT EURO FUTUR 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.	97,54	96,97
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.		
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.	1,90	1,89

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

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

# OPCVM BFT EURO FUTUR 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	35 088 348,75	96,56	96,00
Livre Sterling	GBP	355 371,13	0,98	0,97
TOTAL		35 443 719,88	97,54	96,97

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

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

# OPCVM BFT EURO FUTUR 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	33,29	33,09
PAYS-BAS	19,29	19,17
ALLEMAGNE	11,80	11,73
BELGIQUE	9,89	9,83
ITALIE	8,60	8,55
AUTRICHE	5,88	5,84
ESPAGNE	3,06	3,04
IRLANDE	2,70	2,68
FINLANDE	2,01	2,00
LUXEMBOURG	0,53	0,53
PORTUGAL	0,50	0,50
TOTAL	97,54	96,97

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

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

# OPCVM BFT EURO FUTUR ISR

## Répartition des autres actifs du E) du portefeuille titres, par nature

Nature d'actifs	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
<b>Organismes de placement collectif</b>		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	1,90	1,89
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		
<b>Autres actifs</b>		
Autres		
<b>TOTAL</b>	<b>1,90</b>	<b>1,89</b>

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

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

# OPCVM BFT EURO FUTUR 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.	5 993 212,74	8 162 262,44
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.	2 993 145,80	3 114 307,04

## Distribution en cours de période

	Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
<b>Dividendes versés</b>				
08/12/2023	BFT EURO FUTUR ISR I-D	24,16	3,059	27,219
<b>Dividendes à verser</b>				
	BFT EURO FUTUR ISR I-D			

# OPCVM BFT EURO FUTUR ISR

## Information sur les commissions de surperformance (En EUR)

	29/02/2024
<b>Parts BFT EURO FUTUR ISR I-C</b> 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)	
<b>Parts BFT EURO FUTUR ISR I-D</b> 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)	
<b>Parts BFT EURO FUTUR ISR P-C</b> 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 EURO FUTUR 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 EURO FUTUR ISR

## Portefeuille titres détaillé au 29/02/2024 en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Actions et valeurs assimilées</b>				
<b>Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
AIXTRON SE	EUR	21 000	539 280,00	1,48
BRENNTAG AG NAMEN	EUR	3 800	320 644,00	0,88
COMMERZBANK AG	EUR	29 000	310 155,00	0,86
COVESTRO AG	EUR	6 700	337 010,00	0,93
DELIVERY HERO SE	EUR	3 750	80 118,75	0,23
DERMAPHARM HOLDING SE	EUR	7 500	276 600,00	0,76
DEUTSCHE LUFTHANSA NOMINATIVE	EUR	16 000	115 008,00	0,31
DWS GROUP GMBH & CO KGAA	EUR	11 250	426 375,00	1,18
EVONIK INDUSTRIES AG	EUR	8 250	140 745,00	0,39
GEA GROUP	EUR	2 000	74 540,00	0,20
HEIDELBERGER ZEMENT	EUR	2 250	201 825,00	0,56
HELLOFRESH AG	EUR	5 000	64 050,00	0,17
KION GROUP AG	EUR	3 600	167 832,00	0,46
LEG IMMOBILIEN SE	EUR	2 950	200 659,00	0,55
MTU AERO ENGINES HOLDINGS AG	EUR	1 450	322 335,00	0,89
PUMA SE	EUR	2 900	123 163,00	0,34
SIEMENS ENERGY AG	EUR	13 000	184 665,00	0,50
SYMRISE AG	EUR	3 000	283 680,00	0,78
ZALANDO SE	EUR	6 100	119 072,00	0,33
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>4 287 756,75</b>	<b>11,80</b>
<b>AUTRICHE</b>				
ANDRITZ AG	EUR	11 750	682 675,00	1,88
BAWAG GROUP AG	EUR	2 900	151 525,00	0,42
ERSTE GROUP BANK	EUR	9 250	341 325,00	0,94
TELEKOM AUSTRIA AG	EUR	102 000	748 680,00	2,06
ZUMTOBEL AG	EUR	35 000	211 050,00	0,58
<b>TOTAL AUTRICHE</b>			<b>2 135 255,00</b>	<b>5,88</b>
<b>BELGIQUE</b>				
BARCO NV	EUR	28 500	467 970,00	1,29
D'IETEREN GROUP	EUR	4 550	809 900,00	2,23
FAGRON	EUR	37 500	673 875,00	1,85
GBL GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	EUR	2 250	156 015,00	0,43
KBC GROUPE	EUR	7 850	509 465,00	1,40
SYENSQO SA	EUR	750	61 957,50	0,17
UMICORE	EUR	3 250	62 692,50	0,17
UNION CHIMIQUE BELGE/ UCB	EUR	8 000	852 000,00	2,35
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>3 593 875,00</b>	<b>9,89</b>
<b>ESPAGNE</b>				
BANCO DE SABADELL S.A.	EUR	75 000	89 775,00	0,25
GRIFOLS SA SHARES A	EUR	8 000	60 672,00	0,17

# OPCVM BFT EURO FUTUR ISR

## Portefeuille titres détaillé au 29/02/2024 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
GRUPO EMPRESARIAL ENCE S.A.	EUR	60 000	171 120,00	0,47
REPSOL	EUR	35 000	515 375,00	1,42
SOLTEC POWER HOLDINGS SA	EUR	55 000	145 640,00	0,40
VIDRALA S.A.	EUR	1 350	128 115,00	0,35
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>1 110 697,00</b>	<b>3,06</b>
<b>FINLANDE</b>				
STORA ENSO AB EX ENSO OYJ	EUR	21 500	251 120,00	0,69
UPM-KYMMENE OY	EUR	15 500	479 415,00	1,32
<b>TOTAL FINLANDE</b>			<b>730 535,00</b>	<b>2,01</b>
<b>FRANCE</b>				
ACCOR	EUR	8 150	326 733,50	0,90
ALSTOM	EUR	25 000	308 500,00	0,85
ALTEN	EUR	3 100	420 670,00	1,16
ARKEMA	EUR	3 000	287 280,00	0,79
BILENDI SA	EUR	8 000	120 960,00	0,33
BIOMERIEUX	EUR	850	85 935,00	0,24
CAPGEMINI SE	EUR	800	179 760,00	0,49
CARBIOS	EUR	10 000	246 000,00	0,68
CARREFOUR	EUR	10 000	155 300,00	0,43
CHARGEURS SA	EUR	11 500	137 310,00	0,38
CIE DES ALPES	EUR	46 500	614 730,00	1,69
COVIVIO	EUR	5 500	228 360,00	0,63
CREDIT AGRICOLE	EUR	50 750	635 390,00	1,75
DONT NOD ENTERTAINMENT SA	EUR	36 000	119 520,00	0,33
EDENRED	EUR	6 000	274 740,00	0,76
EIFFAGE	EUR	1 500	150 975,00	0,42
ELIS	EUR	22 000	464 200,00	1,27
ENTECH SACA	EUR	18 000	141 840,00	0,39
ESKER SA	EUR	1 500	240 750,00	0,66
EUROAPI SASU	EUR	33 500	128 975,00	0,35
EXAIL TECHNOLOGIES	EUR	1 250	27 125,00	0,08
FAURECIA EX BERTRAND FAURE	EUR	20 500	269 882,50	0,74
GAZTRANSPORT ET TECHNIGA SA	EUR	4 350	622 050,00	1,71
GECINA SA	EUR	1 900	169 670,00	0,47
GROUPE OKWIND SAS	EUR	10 000	197 000,00	0,54
GUERBET	EUR	2 000	60 000,00	0,16
INTERPARFUMS	EUR	4 500	232 200,00	0,64
LAURENT-PERRIER GROUP	EUR	350	43 050,00	0,12
MEDINCELL SA	EUR	24 000	212 160,00	0,58
NEOEN SA	EUR	3 750	86 850,00	0,24
NEXANS SA	EUR	4 850	460 750,00	1,27
NEXITY	EUR	6 250	66 312,50	0,18
PUBLICIS GROUPE SA	EUR	13 000	1 271 140,00	3,49
SAINT-GOBAIN	EUR	3 150	224 280,00	0,62

# OPCVM BFT EURO FUTUR ISR

## Portefeuille titres détaillé au 29/02/2024 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SCOR SE	EUR	3 800	107 084,00	0,30
SOITEC SA	EUR	2 200	297 330,00	0,82
SR TELEPERFORMANCE	EUR	1 350	154 642,50	0,42
THERMADOR GROUPE	EUR	900	73 260,00	0,20
TRANSGENE SA	EUR	75 000	78 000,00	0,21
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	EUR	9 000	608 220,00	1,68
VEOLIA ENVIRONNEMENT	EUR	16 000	458 400,00	1,26
VIVENDI	EUR	15 000	154 950,00	0,43
VOLTALIA	EUR	22 000	156 640,00	0,43
WAGA ENERGY SA W/I	EUR	12 650	215 050,00	0,60
WAVESTONE	EUR	7 550	422 800,00	1,16
WORLDLINE SA	EUR	15 000	159 375,00	0,44
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>12 096 150,00</b>	<b>33,29</b>
<b>IRLANDE</b>				
AIB GROUP PLC	EUR	47 500	203 585,00	0,56
BANK OF IRELAND GROUP PLC	EUR	17 000	136 918,00	0,37
KERRY GROUP PLC-A	EUR	3 500	283 990,00	0,79
SMURFIT KAPPA GROUP PLC	GBP	9 000	355 371,13	0,98
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>979 864,13</b>	<b>2,70</b>
<b>ITALIE</b>				
BANCO BPM SPA	EUR	27 500	147 785,00	0,41
BFF BANK SPA	EUR	5 000	53 950,00	0,15
FINECOBANK SPA	EUR	16 750	214 065,00	0,59
HERA SPA	EUR	75 000	239 700,00	0,66
IVECO GROUP NV	EUR	8 000	91 040,00	0,25
LEONARDO SPA	EUR	14 750	291 386,25	0,80
MAIRE TECNIMONT SPA	EUR	36 000	190 800,00	0,53
MEDIOBANCA SPA	EUR	15 000	188 925,00	0,52
MONCLER SPA	EUR	6 500	433 290,00	1,19
NEXI SPA	EUR	40 000	270 960,00	0,74
PRYSMIAN SPA	EUR	14 250	656 212,50	1,80
TERNA	EUR	48 000	347 712,00	0,96
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>3 125 825,75</b>	<b>8,60</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
EUROFINS SCIENTIFIC	EUR	3 500	193 340,00	0,53
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>193 340,00</b>	<b>0,53</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
ABN AMRO BANK NV-CVA	EUR	11 000	163 350,00	0,45
AEGON NV	EUR	55 000	305 030,00	0,84
AKZO NOBEL	EUR	2 000	134 680,00	0,37
ARCADIS	EUR	17 650	951 335,00	2,61
ASM INTERNATIONAL NV	EUR	850	479 145,00	1,32
ASR NEDERLAND NV	EUR	23 750	1 012 462,50	2,78
BE SEMICONDUCTOR INDUSTRIES	EUR	1 250	208 937,50	0,58

# OPCVM BFT EURO FUTUR ISR

## Portefeuille titres détaillé au 29/02/2024 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
EURONEXT NV - W/I	EUR	9 000	767 250,00	2,11
IMCD BV	EUR	1 500	211 350,00	0,59
KONINKLIJKE KPN NV	EUR	112 500	380 587,50	1,05
NN GROUP NV	EUR	9 000	371 340,00	1,03
QIAGEN N.V.	EUR	17 250	683 703,75	1,88
RANDSTAD N.V.	EUR	2 750	140 085,00	0,38
SIGNIFY NV	EUR	11 000	272 580,00	0,75
STELLANTIS NV	EUR	24 000	579 240,00	1,59
TKH GROUP	EUR	9 000	347 220,00	0,95
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>7 008 296,25</b>	<b>19,28</b>
<b>PORTUGAL</b>				
GALP ENERGIA SGPS SA	EUR	12 500	182 125,00	0,50
<b>TOTAL PORTUGAL</b>			<b>182 125,00</b>	<b>0,50</b>
<b>TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>35 443 719,88</b>	<b>97,54</b>
<b>TOTAL Actions et valeurs assimilées</b>			<b>35 443 719,88</b>	<b>97,54</b>
<b>Organismes de placement collectif</b>				
<b>OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>				
<b>FRANCE</b>				
BFTFRANCE MONETAIRE COURT TERME ISR I C	EUR	50,1962	691 336,70	1,90
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>691 336,70</b>	<b>1,90</b>
<b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>			<b>691 336,70</b>	<b>1,90</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>691 336,70</b>	<b>1,90</b>
<b>Créances</b>			<b>289 061,97</b>	<b>0,80</b>
<b>Dettes</b>			<b>-212 908,36</b>	<b>-0,59</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>126 517,73</b>	<b>0,35</b>
<b>Actif net</b>			<b>36 337 727,92</b>	<b>100,00</b>



## **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