



**INNOVER  
POUR LA  
PERFORMANCE**

90, BOULEVARD PASTEUR  
CS 61595  
75730 PARIS CEDEX 15

T 01 53 15 70 00

W [WWW.CPR-AM.COM](http://WWW.CPR-AM.COM)

# CPR MONETAIRE ISR

OPCVM relevant de la Directive 2009/65/CE  
FCP de droit français

---

**RAPPORT SEMESTRIEL**

**EXERCICE CLOS LE 30 SEPTEMBRE 2021**

---

## 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	6 061 009 240,02
b) Avoirs bancaires	1 499 088 920,59
c) Autres actifs détenus par l'OPC	2 208 520 744,58
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	9 768 618 905,19
e) Passif	-8 236 288,59
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	9 760 382 616,60

\* 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
CPR MONETAIRE ISR I en EUR	C	2 335 548 214,69	114 695,086	20 363,10
CPR MONETAIRE ISR P en EUR	C	274 768 228,73	695 366,903	395,141
CPR MONETAIRE ISR-S en EUR	C	2 411,99	2,426	994,22
CPR Monétaire ISR SI en EUR	C	7 094 616 771,11	356 108,130	19 922,64
CPR MONETAIRE ISR - Y SR en EUR	C	55 446 990,08	56 231,807	986,04

## 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.	52,11	52,06
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.	9,99	9,98
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.	10,40	10,40

\* 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 **
Euro	EUR	6 061 009 240,02	62,10	62,05
TOTAL		6 061 009 240,02	62,10	62,05

\* 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 **
FRANCE	32,15	32,13
ROYAUME-UNI	6,87	6,87
PAYS-BAS	4,10	4,10
ESPAGNE	3,43	3,42
ITALIE	3,06	3,06
LUXEMBOURG	2,89	2,89
IRLANDE	2,70	2,70
ETATS-UNIS	2,57	2,56
SUEDE	1,57	1,57
FINLANDE	1,44	1,44
ALLEMAGNE	0,39	0,39
BELGIQUE	0,37	0,37
JAPON	0,31	0,31
CANADA	0,24	0,24
TOTAL	62,10	62,05

\* 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 **
<b>Organismes de placement collectif</b>		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	10,40	10,40
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>10,40</b>	<b>10,40</b>

\* 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

Éléments 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.	12 238 202 794,93	9 049 777 667,45
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.	1 972 372 793,20	1 280 779 937,80
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.	1 200 008 647,07	510 329 969,40

## Transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation des instruments financiers - Règlement SFTR - en devise de comptabilité de l'OPC (EUR)

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

### a) Titres et matières premières prêtés

Montant					
% de l'Actif Net*					

\*% hors trésorerie et équivalent de trésorerie

### b) Actifs engagés pour chaque type d'opérations de financement sur titres et TRS exprimés en valeur absolue

Montant				1 038 420 424,28	
% de l'Actif Net				10,64%	

### c) 10 principaux émetteurs de garanties reçues (hors cash) pour tous les types d'opérations de financement

ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO ITALIE				542 447 094,05	
SPAIN GOVERNMENT BOND ESPAGNE				475 544 180,89	
ITALY CERT DI CREDITO DEL TESORO-CCTSA ITALIE				7 995 418,40	
SPAIN I/L BOND ESPAGNE				4 000 841,75	
ESPAGNE ESPAGNE				2 001 077,18	

### d) 10 principales contreparties en valeur absolue des actifs et des passifs sans compensation

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA (MADRID) ESPAGNE				565 118 138,20	
LA BANQUE POSTALE FRANCE				473 302 286,08	

# OPCVM CPR MONETAIRE ISR

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

## e) Type et qualité des garanties (collatéral)

Type					
- Actions					
- Obligations					
- OPC					
- TCN					
- Cash					
<b>Rating</b>					
<b>Monnaie de la garantie</b>					
Euro					

## f) Règlement et compensation des contrats

Triparties				X	
Contrepartie centrale					
Bilatéraux	X			X	

## g) Échéance de la garantie ventilée en fonction des tranches

Moins d'1 jour					
1 jour à 1 semaine					
1 semaine à 1 mois				1 998 040,98	
1 à 3 mois					
3 mois à 1 an				1 998 976,33	
Plus d'1 an				186 517 598,36	
Ouvertes				841 473 996,60	

## h) Échéance des opérations de financement sur titres et TRS ventilée en fonction des tranches

Moins d'1 jour					
1 jour à 1 semaine				99 999 740,00	
1 semaine à 1 mois				938 420 684,28	
1 à 3 mois					
3 mois à 1 an					
Plus d'1 an					
Ouvertes					

# OPCVM CPR MONETAIRE ISR

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

## i) Données sur la réutilisation des garanties

Montant maximal (%)					
Montant utilisé (%)					
Revenus pour l'OPC suite au réinvestissement des garanties espèces en euros					

## j) Données sur la conservation des garanties reçues par l'OPC

CACEIS Bank					
Titres				1 031 988 612,27	
Cash					

## k) Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC

Titres					
Cash					

## l) Données sur les revenus et les coûts ventilés

<b>Revenus</b>					
- OPC					
- Gestionnaire					
- Tiers					
<b>Coûts</b>					
- OPC				3 246 215,03	
- Gestionnaire					
- Tiers					

## e) Données Type et qualité des garanties (collatéral)

CPR Asset Management veille à n'accepter que des titres d'une haute qualité de crédit et veille à rehausser la valeur de ses garanties en appliquant des décotes de valorisation sur les titres reçus. Ce dispositif est régulièrement revu et remis à jour.

## i) Données sur la réutilisation des garanties

« La réglementation applicable aux OPCVM interdit la réutilisation par ce dernier des garanties reçues en titres. Les garanties reçues en espèces sont réinvesties dans les 5 supports suivants :

- o OPCVM monétaires court terme (tels que définis par l'ESMA dans ses orientations sur les fonds cotés et autres questions liées aux OPCVM)
- o Dépôt
- o Titres d'Etats Long Terme de haute qualité
- o Titres d'Etats Court Terme de haute qualité
- o Prises en pension »

Le montant maximal de réutilisation est de 0% pour les titres et 100% du montant reçu pour les espèces.

Le montant utilisé est de 0% pour les titres et 100% pour les espèces reçus.

## **k) Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC**

CPR Asset Management veille à travailler avec un nombre réduit de dépositaires, sélectionnés pour s'assurer de la bonne conservation des titres reçus et du cash.

## **l) Données sur les revenus et les coûts ventilés**

Opérations de prêts de titres et de mise en pension :

Dans le cadre des opérations de prêts de titres et de mise en pension, CPR Asset Management, a confié à Amundi Intermédiation, pour le compte de l'OPC, les réalisations suivantes : la sélection des contreparties, la demande de mise en place des contrats de marché, le contrôle du risque de contrepartie, le suivi qualitatif et quantitatif de la collatéralisation (contrôles de dispersion, des notations, des liquidités), des pensions et prêts de titres. Les revenus provenant des opérations de prêts de titres bénéficient à l'OPC, déduction faite des coûts opérationnels supportés par la société de gestion dans le cadre de la mise en place de ces opérations, lesquels coûts n'excéderont pas 40% des revenus générés par lesdites opérations.

## Portefeuille titres détaillé au 30/09/2021 en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Dépôts</b>				
BBVA 171221	EUR	30 000 000	29 994 150,00	0,31
CDT MUT ARKEA 031221	EUR	60 000 000	59 770 558,83	0,61
<b>TOTAL Dépôts</b>			<b>89 764 708,83</b>	<b>0,92</b>
<b>Obligations et valeurs assimilées</b>				
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG E3R+0.7% 06-04-23	EUR	38 000 000	38 242 679,74	0,39
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>38 242 679,74</b>	<b>0,39</b>
<b>CANADA</b>				
CAN IMP BK E3R+0.75% 21-06-23	EUR	23 500 000	23 744 487,66	0,24
<b>TOTAL CANADA</b>			<b>23 744 487,66</b>	<b>0,24</b>
<b>ESPAGNE</b>				
INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL 0.25% 30-04-22	EUR	9 500 000	9 553 417,98	0,10
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>9 553 417,98</b>	<b>0,10</b>
<b>ETATS-UNIS</b>				
ARCHER DANIELS MIDLAND 0.0% 25-09-22	EUR	30 000 000	30 083 580,30	0,31
ATT 0.0% 01-04-22 EMTN	EUR	40 000 000	40 087 212,00	0,41
CITIGROUP GLOBAL MKTS E3R+0.75% 24-02-22	EUR	25 000 000	25 068 523,28	0,26
GEN MILLS 0.0% 16-11-21 EMTN	EUR	40 000 000	40 017 780,80	0,41
GEN MILLS E3R+0.29% 27-07-23	EUR	40 000 000	40 208 967,60	0,41
PROLOGIS EURO FINANCE LLC E3R+0.28% 23-12-22	EUR	35 000 000	35 042 231,70	0,36
<b>TOTAL ETATS-UNIS</b>			<b>210 508 295,68</b>	<b>2,16</b>
<b>FINLANDE</b>				
OP CORPORATE BANK E3R+1.05% 10-08-22	EUR	20 000 000	20 182 068,87	0,21
<b>TOTAL FINLANDE</b>			<b>20 182 068,87</b>	<b>0,21</b>
<b>FRANCE</b>				
LVMH MOET HENNESSY E3R+0.2% 11-02-22	EUR	27 900 000	27 951 304,75	0,29
VILOGIA STE ANONYME D HLM E3R+0.6% 08-10-21	EUR	15 000 000	15 002 177,39	0,15
VILOGIA STE ANONYME D HLM E3R+0.75% 27-07-23	EUR	16 000 000	16 136 481,35	0,16
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>59 089 963,49</b>	<b>0,60</b>
<b>ITALIE</b>				
MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ 0.0% 29-07-22	EUR	15 000 000	15 032 043,00	0,15
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>15 032 043,00</b>	<b>0,15</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
TRATON FINANCE LUXEMBOURG E3R+0.75% 27-08-23	EUR	20 000 000	20 166 472,18	0,21
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>20 166 472,18</b>	<b>0,21</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
DE VOLKSBANK NV	EUR	4 200 000	4 218 905,67	0,04
DE VOLKSBANK NV E3R+0.75% 07-10-22	EUR	7 900 000	7 953 293,25	0,08
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0.75% 19-01-23	EUR	20 000 000	20 174 045,42	0,21
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0.75% 23-06-23	EUR	15 000 000	15 136 681,15	0,15

## Portefeuille titres détaillé au 30/09/2021 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0.75% 25-08-23	EUR	21 000 000	21 243 739,21	0,22
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0.75% 28-09-22	EUR	8 000 000	8 048 626,40	0,08
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>76 775 291,10</b>	<b>0,78</b>
<b>ROYAUME-UNI</b>				
BARCLAYS BK 0.0% 10-02-22 EMTN	EUR	20 000 000	20 033 115,20	0,21
<b>TOTAL ROYAUME-UNI</b>			<b>20 033 115,20</b>	<b>0,21</b>
<b>SUEDE</b>				
VOLVO TREASURY AB E3R+0.75% 13-09-23	EUR	32 400 000	32 757 816,20	0,34
<b>TOTAL SUEDE</b>			<b>32 757 816,20</b>	<b>0,34</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>526 085 651,10</b>	<b>5,39</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées</b>			<b>526 085 651,10</b>	<b>5,39</b>
<b>Titres de créances</b>				
<b>Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>BELGIQUE</b>				
BNP PARIBAS FORTIS SA 140922 FIX -0.5	EUR	36 000 000	36 174 845,08	0,37
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>36 174 845,08</b>	<b>0,37</b>
<b>ESPAGNE</b>				
BANCO SANTANDER S.A 221121 FIX -0.5	EUR	47 000 000	47 037 561,42	0,48
BANCO SANTANDER SA 270422 FIX -0.4925	EUR	100 000 000	100 285 367,58	1,03
CAIXABANK SA 101221 FIX -0.54	EUR	25 000 000	25 026 277,59	0,26
CAIXABANK SA 191121 FIX -0.55	EUR	25 000 000	25 018 729,30	0,26
ENDESA SA 301121 FIX -0.495	EUR	40 000 000	40 033 027,25	0,41
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A. 080722	EUR	9 500 000	9 534 855,19	0,09
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A. 130722	EUR	27 500 000	27 607 092,51	0,28
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>274 542 910,84</b>	<b>2,81</b>
<b>FINLANDE</b>				
NORDEA BANK ABP. 020522 FIX -0.5	EUR	46 000 000	46 134 611,95	0,47
NORDEA BANK ABP. 200922 FIX -0.49	EUR	70 000 000	70 329 118,00	0,72
OP CORPORATE BANK PLC 040522 FIX -0.5	EUR	4 000 000	4 011 980,22	0,04
<b>TOTAL FINLANDE</b>			<b>120 475 710,17</b>	<b>1,23</b>
<b>FRANCE</b>				
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 140322 FIX -	EUR	5 000 000	5 010 614,15	0,05
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 220322 FIX -	EUR	5 000 000	5 011 133,07	0,05
AGEN CENT ORGA SEC ZCP 04-11-21	EUR	50 000 000	50 023 828,16	0,51
ARVA SERV LEAS ZCP 24-05-22	EUR	8 000 000	8 025 376,69	0,08
BANQ P E3R+0.27% 25-10-21	EUR	20 000 000	19 989 615,00	0,20
BANQUE PALATINE 161221 FIX -0.53	EUR	35 000 000	35 039 204,98	0,36
BANQUE PALATINE 170522 OISEST 0.07	EUR	40 000 000	39 975 055,50	0,41
BANQUE PALATINE 180522 OISEST 0.1	EUR	40 000 000	39 928 463,49	0,41
BFCM (BANQUE FE 071221 OIS 0.03	EUR	50 000 000	49 814 064,56	0,51
BFCM (BANQUE FE 101221 OIS 0.03	EUR	60 000 000	59 783 297,03	0,61
BFCM (BANQUE FEDER 030522 OISEST 0.09	EUR	50 000 000	49 900 717,89	0,51
BFCM (BANQUE FEDER 050822 OISEST 0.07	EUR	19 000 000	18 985 260,05	0,19

## Portefeuille titres détaillé au 30/09/2021 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BFCM (BANQUE FEDER 090922 OISEST 0.07	EUR	27 000 000	26 991 751,48	0,28
BFCM (BANQUE FEDER 220722 OISEST 0.06	EUR	15 000 000	14 985 171,08	0,15
BFCM BANQ FEDE CRE ZCP 05-10-21	EUR	100 000 000	100 005 000,25	1,03
BFCM B OISEST+0.06% 23-09-22	EUR	40 000 000	39 996 027,97	0,41
BFCM B OISEST+0.07% 01-07-22	EUR	15 000 000	14 981 128,87	0,16
BFCM B OISEST+0.13% 22-10-21	EUR	90 000 000	89 630 818,27	0,92
BNP PA OISEST+0.04% 19-11-21	EUR	40 000 000	39 977 067,13	0,41
BNP PA OISEST+0.045% 10-03-22	EUR	11 000 000	10 996 631,83	0,12
BNP PA OISEST+0.045% 14-03-22	EUR	12 500 000	12 496 719,19	0,13
BNP PA OISEST+0.07% 08-04-22	EUR	9 500 000	9 488 961,66	0,09
BNP PA OISEST+0.07% 11-08-22	EUR	29 000 000	28 979 907,83	0,29
BNP PA OISEST+0.07% 19-08-22	EUR	100 000 000	99 937 978,44	1,02
BNP PA OISEST+0.07% 22-08-22	EUR	65 000 000	64 964 846,59	0,66
BNP PA OISEST+0.14% 08-10-21	EUR	11 000 000	10 954 142,31	0,12
BNP PAR ESTR+0.1% 25-11-21	EUR	10 500 000	10 458 802,85	0,10
BNP PARIBAS 010922 OISEST 0.09	EUR	29 500 000	29 488 604,50	0,30
BNP PARIBAS 040822 OISEST 0.08	EUR	9 500 000	9 492 649,74	0,10
BNP PAR ZCP 01-11-21	EUR	23 000 000	23 009 664,69	0,24
BPCE OISEST+0.065% 11-01-22	EUR	24 200 000	24 111 684,10	0,25
BPCE OISEST+0.07% 02-09-22	EUR	19 000 000	18 992 617,61	0,20
BPCE OISEST+0.07% 23-09-22	EUR	39 000 000	38 996 203,10	0,40
BPCE OISEST+0.075% 03-06-22	EUR	19 000 000	18 968 857,73	0,19
BPCE OISEST+0.075% 06-07-22	EUR	19 000 000	18 977 369,97	0,19
BPCE OISEST+0.095% 08-04-22	EUR	19 000 000	18 956 266,05	0,20
BPCE OISEST+0.125% 08-10-21	EUR	22 000 000	21 905 108,96	0,22
BPCE SA 031221 OISEST 0.095	EUR	15 000 000	14 941 215,95	0,15
BPCE SA 050522 OISEST 0.085	EUR	22 000 000	21 956 076,28	0,22
BPCE SA 050822 OISEST 0.075	EUR	19 000 000	18 985 407,83	0,19
BPCE SA 070922 OISEST 0.07	EUR	27 000 000	26 991 003,24	0,28
BPCE SA 080222 OISEST 0.075	EUR	19 000 000	18 939 226,39	0,19
BPCE SA 090322 OISEST 0.085	EUR	15 000 000	14 958 758,80	0,16
BPCE SA 090922 OISEST 0.07	EUR	50 000 000	49 985 419,29	0,52
BPCE SA 110722 OISEST 0.065	EUR	24 000 000	23 982 870,80	0,25
BPCE SA 181021 OISEST 0.075	EUR	10 000 000	9 960 866,40	0,10
BPCE SA 310822 0.07	EUR	30 000 000	29 987 095,99	0,30
BPCE ZCP 04-11-21	EUR	21 000 000	21 009 722,83	0,22
BPCE ZCP 29-10-21	EUR	35 000 000	35 012 990,66	0,36
BPIFRANCE FINANCEMENT (EX OSEO) 031221 F	EUR	6 000 000	6 005 359,78	0,06
BPIFRANCE FINANCEMENT (EX OSEO) 081221 F	EUR	9 000 000	9 008 678,36	0,10
BPIFRANCE FINANCEMENT (EX OSEO) 131221 F	EUR	9 000 000	9 009 317,14	0,09
BRED BANQUE POPULAIRE 030122 FIX -0.49	EUR	20 000 000	20 025 068,23	0,20
BRED BANQUE POPULAIRE 081221 FIX -0.54	EUR	20 000 000	20 020 420,83	0,20
BRED BANQUE POPULAIRE 260922 FIX -0.49	EUR	38 000 000	38 187 116,87	0,39

## Portefeuille titres détaillé au 30/09/2021 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BRED BANQUE POPULAIRE 271021 FIX -0.55	EUR	60 000 000	60 024 781,73	0,61
BRED OISEST+0.085% 13-04-22	EUR	29 000 000	28 933 771,18	0,29
CA OISEST+0.07% 04-03-22	EUR	50 000 000	49 855 520,00	0,51
COVIVIO SA (EX F 151121 FIX -0.45	EUR	20 000 000	20 011 256,33	0,20
CRCA A OISEST+0.12% 18-11-21	EUR	25 000 000	24 905 822,83	0,25
CRCA B OISEST+0.08% 19-04-22	EUR	50 000 000	49 885 957,86	0,52
CRCAM AQUITAINE 171221 FIX -0.48	EUR	20 000 000	20 020 554,44	0,20
CRCA P OISEST+0.07% 29-03-22	EUR	50 000 000	49 891 846,62	0,51
CRED M OISEST+0.14% 22-10-21	EUR	40 000 000	39 839 011,04	0,41
DANONE SA 101121 FIX -0.535	EUR	10 000 000	10 005 947,98	0,11
DANONE SA 210222 FIX -0.515	EUR	10 000 000	10 020 498,88	0,11
ENGIE OISEST+0.065% 19-04-22	EUR	25 000 000	24 973 339,42	0,26
ENGIE SA 211021 FIX -0.54	EUR	25 000 000	25 007 502,25	0,26
ENGIE SA 221221 FIX -0.53	EUR	35 000 000	35 042 303,85	0,36
ENGIE SA 261021 FIX -0.535	EUR	14 000 000	14 005 203,32	0,14
GECINA 221121 FIX -0.505	EUR	24 000 000	24 017 519,45	0,25
ICADE SA 061021 FIX -0.455	EUR	30 000 000	30 001 895,95	0,31
ICADE SA 081021 FIX -0.52	EUR	17 000 000	17 001 736,98	0,17
ITM ENTREPRISES 280122 FIX -0.12	EUR	9 500 000	9 503 769,83	0,10
KLEPIERRE 261021 FIX -0.515	EUR	10 000 000	10 003 577,67	0,11
LA BANQUE POSTALE 301121 FIX -0.505	EUR	59 000 000	59 049 700,16	0,61
NATI OISEST+0.065% 31-12-21	EUR	40 000 000	39 890 812,79	0,41
SCHNEIDER ELECTRIC SE 181021 FIX -0.485	EUR	49 000 000	49 011 224,93	0,50
SEB SA 210222 FIX -0.46	EUR	7 000 000	7 012 813,97	0,07
SG OISEST+0.065% 02-09-22	EUR	23 500 000	23 489 790,68	0,24
SG OISEST+0.08% 01-03-22	EUR	15 000 000	14 956 726,52	0,15
SG OISEST+0.08% 24-10-22	EUR	24 000 000	23 997 741,48	0,25
SG OISEST+0.08% 31-01-22	EUR	10 000 000	9 967 003,26	0,10
SG OISEST+0.09% 02-08-22	EUR	47 500 000	47 462 109,25	0,49
SG OISEST+0.09% 04-04-22	EUR	19 000 000	18 953 793,56	0,20
SG OISEST+0.09% 04-07-22	EUR	27 500 000	27 466 056,29	0,28
SG OISEST+0.095% 13-12-21	EUR	10 000 000	9 962 085,12	0,10
SG OISEST+0.095% 13-12-21	EUR	15 000 000	14 942 935,90	0,15
SG OISEST+0.1% 02-05-22	EUR	40 000 000	39 921 812,20	0,41
SG OISEST+0.1% 02-06-22	EUR	100 000 000	99 843 143,67	1,02
SG OISEST+0.115% 02-12-21	EUR	30 000 000	29 886 718,40	0,31
SG OISEST+0.125% 02-11-21	EUR	80 000 000	79 673 206,40	0,81
SG OISEST+0.135% 02-11-21	EUR	11 000 000	10 956 476,44	0,11
SG OISEST+0.155% 04-10-21	EUR	37 000 000	36 846 990,45	0,38
SOCIETE DES AUTOR 140422 FIX -0.455	EUR	9 000 000	9 022 236,05	0,09
SOCIETE GENERALE SA 040122 OISEST 0.105	EUR	50 000 000	49 827 702,50	0,51
SOCIETE GENERALE SA 201221 OISEST 0.105	EUR	50 000 000	49 818 230,88	0,51
SYNDICAT TRANSPO 060422 FIX -0.47	EUR	43 000 000	43 105 236,65	0,44

## Portefeuille titres détaillé au 30/09/2021 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
THALES SA 011021 FIX -0.51	EUR	5 000 000	5 000 000,00	0,05
UNIO NAT INTE EMPL ZCP 15-10-21	EUR	80 000 000	80 014 624,90	0,82
UNION FINANCES GRAINS (UFG) 051121 FIX -0.46	EUR	9 000 000	9 004 026,80	0,10
VEOL ENVI ZCP 29-11-21	EUR	5 000 000	5 004 552,06	0,05
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 070222 FIX -0.48	EUR	50 000 000	50 086 148,17	0,51
WORLDLINE SA 111021 FIX -0.495	EUR	14 000 000	14 001 925,26	0,15
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>3 079 324 870,79</b>	<b>31,55</b>
<b>IRLANDE</b>				
BARCLAYS BANK IRELAND PLC 140922 FIX -0.	EUR	28 000 000	28 130 525,64	0,29
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 030622 FIX -0.44	EUR	17 000 000	17 051 058,45	0,17
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 050422 FIX -0.41	EUR	20 000 000	20 042 456,60	0,21
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 140222 FIX -0.41	EUR	60 000 000	60 093 077,50	0,61
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 151121 FIX -0.45	EUR	40 000 000	40 022 512,66	0,41
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 170822	EUR	9 500 000	9 539 855,40	0,10
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 180522	EUR	5 000 000	5 015 793,48	0,05
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 290922 FIX -0.47	EUR	83 000 000	83 395 223,87	0,86
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>263 290 503,60</b>	<b>2,70</b>
<b>ITALIE</b>				
CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 101121 FIX -0.48	EUR	50 000 000	50 026 680,90	0,52
CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 121021 FIX -0.5	EUR	30 000 000	30 004 584,03	0,31
CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 200722 FIX -0.4	EUR	33 000 000	33 107 415,17	0,34
CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 210122 FIX -0.4625	EUR	28 500 000	28 541 067,42	0,29
CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 210422 FIX -0.43	EUR	33 000 000	33 079 814,24	0,34
CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 301221 FIX	EUR	40 000 000	40 048 235,20	0,41
SNAM SPA 160322 FIX -0.475	EUR	29 000 000	29 063 657,48	0,29
SNAM SPA 281021 FIX -0.47	EUR	10 000 000	10 003 526,24	0,10
SNAM ZCP 24-02-22	EUR	10 000 000	10 019 301,07	0,11
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>263 894 281,75</b>	<b>2,71</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
BANK OF CHINA LIMITED 190822 FIX -0.51	EUR	30 000 000	30 137 477,12	0,31
BGL BNP PAR ZCP 29-11-21	EUR	50 000 000	50 040 595,43	0,51
INTESA SANPAOLO 030622 FIX -0.44	EUR	33 000 000	33 099 113,46	0,33
INTESA SANPAOLO 050922 FIX -0.48	EUR	9 500 000	9 543 134,97	0,10
INTESA SANPAOLO 060722 FIX -0.49	EUR	9 500 000	9 536 083,48	0,10
INTESA SANPAOLO 170822 FIX -0.47	EUR	9 500 000	9 539 855,40	0,10
INTESA SANPAOLO 180522 FIX -0.43	EUR	19 000 000	19 052 112,82	0,20
INTESA SANPAOLO 280922 FIX -0.47	EUR	41 000 000	41 194 690,69	0,42
INTESA SANPAOLO B 180522 FIX -0.495	EUR	5 000 000	5 015 793,48	0,05
INTESA SANPAOLO B 210222 FIX -0.465	EUR	9 500 000	9 517 579,76	0,10
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>216 676 436,61</b>	<b>2,22</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 111021 FIX -0.46	EUR	31 000 000	31 003 961,62	0,31
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 080422 FIX -0	EUR	35 000 000	35 093 964,09	0,36

## Portefeuille titres détaillé au 30/09/2021 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 210422 FIX -0	EUR	40 000 000	40 114 795,17	0,41
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 280122 FIX -0.475	EUR	40 000 000	40 062 904,32	0,41
ING BANK N.V. 070422 FIX -0.5	EUR	9 500 000	9 524 870,50	0,09
ING BANK N.V. 100822 FIX -0.52	EUR	9 500 000	9 543 145,62	0,10
ING BANK N.V. 170322 FIX -0.51	EUR	9 500 000	9 522 528,72	0,10
ING BANK N.V. 200722 FIX -0.5	EUR	9 500 000	9 538 684,67	0,10
TELEFONICA EUROPE BV 071221 FIX -0.46	EUR	20 000 000	20 017 136,89	0,21
TELEFONICA EUROPE BV 101121 FIX -0.435	EUR	30 000 000	30 014 507,01	0,31
TENNET HOLDING BV 151021 FIX -0.53	EUR	40 000 000	40 008 246,14	0,42
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>274 444 744,75</b>	<b>2,82</b>
<b>ROYAUME-UNI</b>				
AMCOR UK FINANCE PLC 011221 FIX -0.45	EUR	20 000 000	20 015 362,33	0,21
BARC B OISEST+0.09% 24-08-22	EUR	50 000 000	49 975 367,76	0,52
BARCLAYS BANK PLC 170822 FIX -0.49	EUR	28 500 000	28 624 676,37	0,30
BARCLAYS BANK PLC 270922 FIX -0.47	EUR	24 000 000	24 113 648,97	0,24
NORD BK LOND BRAN ZCP 05-11-21	EUR	32 000 000	32 016 037,29	0,32
NORDEA BANK AB LONDON BRANCH 070222 FIX -0.515	EUR	45 000 000	45 082 055,52	0,46
NORDEA BANK FINLAND PLC/LOND 160922 FIX -0.49	EUR	50 000 000	50 239 334,61	0,51
UNICREDIT LONDON 210322 FIX -0.49	EUR	80 000 000	80 183 334,08	0,82
UNICREDIT SPA 051121 FIX -0.5	EUR	50 000 000	50 024 317,38	0,51
UNICREDIT SPA 070222 FIX -0.48	EUR	25 000 000	25 043 074,09	0,26
UNICREDIT SPA 070222 FIX -0.48	EUR	80 000 000	80 137 837,08	0,83
UNICREDIT SPA 090522 FIX -0.46	EUR	50 000 000	50 139 015,57	0,51
UNICREDIT SPA 291021 FIX -0.5	EUR	45 000 000	45 017 506,81	0,46
UNICREDIT SPA-LONDON BRANCH 140922 FIX -	EUR	20 000 000	20 093 232,60	0,20
UNIC SPAL BRAN ZCP 14-10-21	EUR	50 000 000	50 009 029,41	0,51
<b>TOTAL ROYAUME-UNI</b>			<b>650 713 829,87</b>	<b>6,66</b>
<b>SUEDE</b>				
SVEN HAND AB ZCP 04-11-21	EUR	20 000 000	20 008 881,72	0,21
SVENSKA HANDELSBANKEN AB 280422 FIX -0.5	EUR	100 000 000	100 291 122,84	1,02
<b>TOTAL SUEDE</b>			<b>120 300 004,56</b>	<b>1,23</b>
<b>TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>5 299 838 138,02</b>	<b>54,30</b>
<b>Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ESPAGNE</b>				
NT CONS FIN ZCP 22-08-22	EUR	50 000 000	50 220 687,38	0,52
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>50 220 687,38</b>	<b>0,52</b>
<b>ETATS-UNIS</b>				
FIDE NATL INFO SER ZCP 29-10-21	EUR	40 000 000	40 015 561,61	0,41
<b>TOTAL ETATS-UNIS</b>			<b>40 015 561,61</b>	<b>0,41</b>
<b>ITALIE</b>				
TRASMISSIONE ELE 040222 FIX -0.42	EUR	20 000 000	20 029 443,28	0,20
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>20 029 443,28</b>	<b>0,20</b>
<b>JAPON</b>				

## Portefeuille titres détaillé au 30/09/2021 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CENTRAL NIPPON EXPRESSWAY CO LTD 160522	EUR	30 000 000	30 079 250,96	0,31
<b>TOTAL JAPON</b>			<b>30 079 250,96</b>	<b>0,31</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
INTE BANK LUXE ZCP 29-08-22	EUR	36 000 000	36 160 068,57	0,37
NATWEST MARKETS PLC 081221 FIX -0.37	EUR	9 500 000	9 507 300,70	0,10
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>45 667 369,27</b>	<b>0,47</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
AVER DENN TREA MAN ZCP 27-10-21	EUR	20 000 000	20 007 224,83	0,21
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV 041021 FIX -0.53	EUR	15 000 000	15 000 356,35	0,15
NATWEST MARKETS NV 230922 FIX -0.47	EUR	14 000 000	14 065 557,22	0,14
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>49 073 138,40</b>	<b>0,50</b>
<b>TOTAL Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>235 085 450,90</b>	<b>2,41</b>
<b>TOTAL Titres de créances</b>			<b>5 534 923 588,92</b>	<b>56,71</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>				
AMUNDI EURO LIQUIDITY SHORT TERM SRI PART I2-C	EUR	42 700	420 417 274,06	4,31
AMUNDI TRESO COURT TERME I C	EUR	600	11 077 811,10	0,11
BFT AUREUS ISR I2.	EUR	16 593,537	163 540 397,26	1,67
CPR CASH I	EUR	38	420 523 426,48	4,31
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>1 015 558 908,90</b>	<b>10,40</b>
<b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>			<b>1 015 558 908,90</b>	<b>10,40</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>1 015 558 908,90</b>	<b>10,40</b>
<b>Titres reçus en pension</b>				
<b>ESPAGNE</b>				
ESPAGNE 5.4% 31/01/2023	EUR	1 790 000	1 999 453,78	0,02
ROYA DESP 1.0% 30-11-30	EUR	1 506 000	2 005 167,53	0,02
SPAI GOVE BON 3.45% 30-07-66	EUR	1 214 000	1 916 244,45	0,02
SPAIN GOVERNMENT BOND 0.05% 31-10-21	EUR	1 996 000	1 998 395,20	0,02
SPAIN GOVERNMENT BOND 1.45% 30-04-29	EUR	29 418 000	32 782 016,00	0,34
SPAIN GOVERNMENT BOND 1.85% 30-07-35	EUR	140 155 000	163 000 265,06	1,67
SPAIN GOVERNMENT BOND 2.35% 30-07-33	EUR	216 641 000	264 302 020,02	2,71
SPAIN IL BOND 0.65% 30-11-27	EUR	1 620 000	2 016 322,83	0,02
SPAIN IL BOND 0.7% 30-11-33	EUR	1 523 000	1 986 649,38	0,02
SPGB 0 1/2 04/30/30	EUR	12 771 000	13 217 985,00	0,13
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>485 224 519,25</b>	<b>4,97</b>
<b>ITALIE</b>				
BTPS 2.35 09/15/24	EUR	1 641 000	1 999 793,19	0,02
CCTS 0 06/15/22	EUR	1 991 000	1 999 959,50	0,02
ITALIE 2.55% 15/09/2041	EUR	1 103 000	1 997 605,73	0,02
ITALIE BTP ei 2.35% 15/09/2035	EUR	155 000 000	279 787 000,57	2,87
ITALIE EI 2.60% 09/23	EUR	40 000 000	54 222 002,94	0,55

## Portefeuille titres détaillé au 30/09/2021 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.0% 15-04-24	EUR	90 575 000	91 270 000,28	0,93
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.6% 15-06-23	EUR	8 207 000	8 375 243,50	0,09
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.65% 15-05-26	EUR	22 230 000	24 921 080,33	0,26
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.3% 15-05-28	EUR	30 000 000	37 624 046,16	0,39
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.0% 01-08-29	EUR	37 396 000	44 999 728,68	0,46
ITALY CERT DI CREDITO DEL TESOROCCT E6R+0.55% 15-12-23	EUR	1 980 000	1 999 998,00	0,02
ITALY CERT DI CREDITO DEL TESOROCCT E6R+1.1% 15-10-24	EUR	1 939 000	1 999 981,55	0,02
ITALY E6R+0.65% 15-04-29	EUR	1 974 000	1 999 464,60	0,02
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>553 195 905,03</b>	<b>5,67</b>
<b>TOTAL Titres reçus en pension</b>			<b>1 038 420 424,28</b>	<b>10,64</b>
<b>Indemnités sur titres reçus en pension</b>			<b>-223 298,62</b>	
<b>Créances</b>			<b>65 000 001,19</b>	<b>0,67</b>
<b>Dettes</b>			<b>-8 234 649,38</b>	<b>-0,09</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>1 499 087 281,38</b>	<b>15,36</b>
<b>Actif net</b>			<b>9 760 382 616,60</b>	<b>100,00</b>