



30/09/2021

Fonds de droit français

**GROUPAMA
ENTREPRISES**

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	3 536 148 916,34
b) Avoirs bancaires	529 002 410,68
c) Autres actifs détenus par l'OPC	2 573 752,93
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	4 067 725 079,95
e) Passif	-1 377 089,45
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	4 066 347 990,50

* 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 ENTREPRISES I en EUR	C	3 653 577 667,02	1 619 769,73160	2 255,62
GROUPAMA ENTREPRISES I en EUR	D	3 080 333,76	313,5637	9 823,63
GROUPAMA ENTREPRISES M en EUR	C	96 271 149,18	93 113,85900	1 033,91
GROUPAMA ENTREPRISES N en EUR	C	203 183 902,21	365 358,49930	556,12
GROUPAMA ENTREPRISES R en EUR	C	110 234 938,33	222 765,914	494,85

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>	69,10	69,08
<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>	17,86	17,86
<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	3 536 148 916,34	86,96	86,93
TOTAL		3 536 148 916,34	86,96	86,93

* 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 **
FRANCE	33,16	33,14
ROYAUME-UNI	16,97	16,97
IRLANDE	9,48	9,47
ESPAGNE	6,96	6,96
PAYS-BAS	6,51	6,51
LUXEMBOURG	4,69	4,68
ALLEMAGNE	4,25	4,25
ITALIE	3,97	3,97
ETATS-UNIS	0,89	0,89
DANEMARK	0,09	0,09
TOTAL	86,96	86,93

* 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.	37 847 257 204,19	37 968 651 911,31
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.	2 595 166 324,26	2 216 488 085,94
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.		

DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE

Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt (1) EUR	Montant brut unitaire (2) EUR
Dividendes versés			
GROUPAMA ENTREPRISES ID			
Dividendes à verser			
GROUPAMA ENTREPRISES ID			

(1) Le crédit d'impôt unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

(2) Le montant brut unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

INFORMATIONS DIVERSES

Etablissement dépositaire : CACEIS Bank - 1-3 place Valhubert - 75013 - Paris

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 30/09/2021 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				
VOLK FIN 0.75% 14-10-21 EMTN	EUR	18 000 000	18 137 921,92	0,45
VOLKSWAGEN BANK E3R+0.7% 08-12-21	EUR	30 500 000	30 537 431,97	0,75
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 0.625% 01-04-22	EUR	27 685 000	27 915 655,87	0,69
TOTAL ALLEMAGNE			76 591 009,76	1,89
DANEMARK				
JYSKE BANK DNK 0.875% 03-12-21	EUR	3 500 000	3 533 392,64	0,08
TOTAL DANEMARK			3 533 392,64	0,08
ESPAGNE				
BANCO NTANDER 1.375% 09-02-22	EUR	20 000 000	20 309 147,95	0,50
NT CONS FIN 0.5% 04-10-21 EMTN	EUR	24 000 000	24 121 324,93	0,59
NT CONS FIN 0.875% 24-01-22	EUR	13 400 000	13 536 802,99	0,34
TOTAL ESPAGNE			57 967 275,87	1,43
ETATS-UNIS				
WELL FAR 1.125% 29-10-21 EMTN	EUR	35 793 000	36 208 956,34	0,89
TOTAL ETATS-UNIS			36 208 956,34	0,89
FRANCE				
AUTOROUTE DU SUD 5.625% 07/22	EUR	5 450 000	5 775 973,46	0,13
ILIAD 0.625% 25-11-21	EUR	39 700 000	39 935 663,01	0,98
SG 0.125% 05-10-21 EMTN	EUR	3 000 000	3 003 953,63	0,08
TOTAL FRANCE			48 715 590,10	1,19
IRLANDE				
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 1.0% 15-11-21	EUR	14 900 000	15 057 637,92	0,37
TOTAL IRLANDE			15 057 637,92	0,37
ITALIE				
INTE E3R+0.95% 19-04-22 EMTN	EUR	19 000 000	19 110 203,17	0,47
TOTAL ITALIE			19 110 203,17	0,47
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			257 184 065,80	6,32
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			257 184 065,80	6,32
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ESPAGNE				
ENDESA SA 021121 FIX -0.48	EUR	30 000 000	30 013 612,06	0,74
ENDESA SA 071021 FIX -0.485	EUR	70 000 000	70 010 677,74	1,72
ENDESA SA 291021 FIX -0.485	EUR	50 000 000	50 020 215,17	1,23

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2021 EN EUR(suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ENDESA SA 310122 FIX -0.48	EUR	30 000 000	30 049 280,82	0,74
TOTAL ESPAGNE			180 093 785,79	4,43
FRANCE				
ALSTOM SA 150222 FIX -0.485	EUR	15 000 000	15 026 998,96	0,36
ALSTOM SA 291221 FIX -0.5	EUR	8 750 000	8 761 073,02	0,22
BANQUE PALATINE 031221 FIX -0.53	EUR	15 000 000	15 014 567,98	0,37
BANQUE PALATINE 261121 OIS 0.025	EUR	20 000 000	19 924 270,58	0,49
BANQUE POPULAIRE RIVES DE PARIS 081121 F	EUR	50 000 000	50 029 978,05	1,23
BFCM (BANQUE FE 191121 OIS 0.03	EUR	30 000 000	29 885 211,63	0,73
CA CONSUMER FINANCE 051021 FIX -0.55	EUR	50 000 000	50 004 166,66	1,23
CA CONSUMER FINANCE 071021 FIX -0.55	EUR	50 000 000	50 008 388,34	1,23
CAISSE REG. DE C 031221 OIS 0.025	EUR	20 000 000	19 925 725,77	0,49
CAISSE REGIONALE 251121 OIS 0.025	EUR	20 000 000	19 923 537,97	0,49
CRCAM PYRENEES GASCOGNE 031221 OIS 0.11	EUR	15 000 000	14 944 518,46	0,36
CREDIT LYONNAIS 041021 FIX -0.55	EUR	50 000 000	50 003 472,22	1,23
CREDIT MUTUEL ARKEA 051121 FIX -0.56	EUR	50 000 000	50 028 015,69	1,23
CREDIT MUTUEL ARKEA 051121 OISEST 0.12	EUR	30 000 000	29 879 946,03	0,73
CREDIT MUTUEL ARKEA 301221 FIX -0.54	EUR	50 000 000	50 068 343,29	1,23
ELIS SA EX HOLDELIS SA 050522 FIX 0.175	EUR	7 000 000	6 997 080,64	0,17
ELIS SA EX HOLDELIS SA 050822 FIX 0.125	EUR	8 000 000	7 994 326,30	0,20
ELIS SA EX HOLDELIS SA 051121 FIX 0.25	EUR	5 000 000	5 000 285,47	0,12
ELIS SA EX HOLDELIS SA 100522 FIX 0.175	EUR	5 000 000	4 997 784,58	0,12
ENGIE SA 100122 FIX -0.46	EUR	25 000 000	25 034 168,73	0,62
ENGIE SA 201021 FIX -0.55	EUR	50 000 000	50 017 254,01	1,24
FAURECIA 020222 FIX 0.34	EUR	15 000 000	14 992 951,88	0,36
FAURECIA 020822 FIX 0.18	EUR	6 000 000	5 990 267,07	0,15
FAURECIA 020922 FIX 0.16	EUR	5 000 000	4 990 739,26	0,12
FAURECIA 060922 FIX 0.16	EUR	10 000 000	9 979 875,78	0,25
FAURECIA 151221 FIX 0.04	EUR	25 000 000	24 995 500,21	0,62
FAURECIA 211021 FIX 0.4	EUR	15 000 000	14 998 932,86	0,37
GROUPE EIFFAGE 051121 FIX -0.405	EUR	15 000 000	15 006 929,43	0,37
HAVAS SA 011021 FIX -0.43	EUR	20 000 000	20 000 409,15	0,49
ILIAD SA 110222 FIX -0.27	EUR	27 000 000	27 030 356,81	0,66
ILIAD SA 140122 FIX -0.3	EUR	5 000 000	5 004 763,47	0,12
ILIAD SA 221221 FIX -0.25	EUR	15 000 000	15 010 897,86	0,37
ILIAD SA 260822 FIX -0.23	EUR	15 000 000	15 031 975,21	0,37
LAGARDERE SA 131221 FIX 0.17	EUR	25 000 000	24 989 611,77	0,62
PLASTIC OMNIUM SYSTEMES URBAINS 290722 F	EUR	13 000 000	13 017 085,39	0,32
PLASTIC OMNIUM SYSTEMES URBAINS 291121 FIX -0.21	EUR	10 500 000	10 503 640,81	0,26

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2021 EN EUR(suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
RCI BANQUE I11021 FIX -0.46	EUR	20 000 000	20 003 873,15	0,49
RENAULT SA 090322 FIX -0.12	EUR	20 000 000	20 008 626,24	0,50
RENAULT SA 100322 FIX -0.11	EUR	15 000 000	15 007 514,68	0,37
RENAULT SA 110122 FIX -0.05	EUR	15 000 000	15 004 088,41	0,37
RENAULT SA 140122 FIX -0.07	EUR	5 000 000	5 001 430,34	0,12
RENAULT SA 151021 FIX -0.06	EUR	15 000 000	15 000 827,72	0,37
RENAULT SA 170122 FIX -0.055	EUR	15 000 000	15 004 200,21	0,37
RENAULT SA 211221 FIX -0.095	EUR	5 000 000	5 001 197,51	0,13
RENAULT SA 240122 FIX -0.11	EUR	20 000 000	20 006 549,60	0,50
RENAULT SA 280222 FIX -0.125	EUR	17 000 000	17 007 313,04	0,42
RENAULT SA 291021 FIX -0.06	EUR	15 000 000	15 001 408,17	0,37
SAVENCIA SA 011221 FIX -0.4	EUR	15 000 000	15 010 596,99	0,37
SAVENCIA SA 081221 FIX -0.39	EUR	4 000 000	4 003 041,97	0,10
SAVENCIA SA 091221 FIX -0.39	EUR	11 000 000	11 008 675,20	0,27
SAVENCIA SA 131221 FIX -0.41	EUR	8 000 000	8 006 705,66	0,19
SAVENCIA SA 291021 FIX -0.39	EUR	10 000 000	10 003 292,25	0,25
SAVENCIA SA 291221 FIX -0.41	EUR	18 000 000	18 018 674,35	0,44
THALES SA 011021 FIX -0.41	EUR	4 500 000	4 500 125,00	0,11
UNION FINANCES GRAINS (UFG) 081021 FIX -	EUR	6 000 000	6 000 910,24	0,15
UNION FINANCES GRAINS (UFG) 281021 FIX -0.46	EUR	5 000 000	5 001 853,51	0,12
VALEO SA 010222 FIX -0.16	EUR	7 500 000	7 507 063,29	0,18
VALEO SA 041021 FIX -0.335	EUR	8 000 000	8 000 508,20	0,20
VALEO SA 250122 FIX -0.15	EUR	15 000 000	15 013 404,24	0,37
VALEO SA 301221 FIX 0.235	EUR	10 000 000	10 007 110,02	0,25
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 030222 FIX -0.455	EUR	30 000 000	30 050 343,65	0,73
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 060522 FIX -0.45	EUR	30 000 000	30 083 833,58	0,74
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 120522 FIX -0.45	EUR	25 000 000	25 071 530,12	0,62
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 130422 FIX -0.465	EUR	25 000 000	25 063 235,00	0,61
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 251121 FIX -0.53	EUR	30 000 000	30 025 039,17	0,74
TOTAL FRANCE			1 219 436 022,85	29,99
ITALIE				
ITAL BUON ORDI DEL ZCP 14-12-21	EUR	25 000 000	25 029 635,09	0,62
UNICREDIT SPA 101121 OIS 0.07	EUR	30 000 000	29 892 442,98	0,73
TOTAL ITALIE			54 922 078,07	1,35
LUXEMBOURG				
MEDIOBANCA INTERNATIONAL (LUX) 050822 FI	EUR	20 000 000	20 080 927,70	0,49
MEDIOBANCA INTERNATIONAL (LUX) 090222 FI	EUR	30 000 000	30 052 916,81	0,74
TOTAL LUXEMBOURG			50 133 844,51	1,23
ROYAUME-UNI				

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2021 EN EUR(suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BARC B OIEST+0.1% 01-02-22	EUR	30 000 000	29 911 346,34	0,74
BARC B OIEST+0.13% 30-03-22	EUR	50 000 000	49 895 260,06	1,23
BARC B OIEST+0.14% 31-03-22	EUR	30 000 000	29 944 496,55	0,73
UNICREDIT LONDON 131021 FIX -0.55	EUR	30 000 000	30 007 518,52	0,74
UNICREDIT SPA 041021 FIX -0.55	EUR	30 000 000	30 002 083,33	0,74
UNICREDIT SPA 061221 FIX -0.53	EUR	130 000 000	130 130 573,92	3,20
UNICREDIT SPA 251021 FIX -0.55	EUR	30 000 000	30 012 463,53	0,74
UNICREDIT SPA 271021 FIX -0.55	EUR	50 000 000	50 021 533,69	1,23
UNICREDIT SPA-LON 161121 OIS 0.5	EUR	20 000 000	20 005 528,88	0,49
UNIC SPAL BRA OIEST 27-07-22	EUR	20 000 000	19 977 480,40	0,49
TOTAL ROYAUME-UNI			419 908 285,22	10,33
TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			1 924 494 016,44	47,33
Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
VOLKSWAGEN AG 280122 FIX -0.305	EUR	25 000 000	25 026 785,91	0,61
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 280222	EUR	41 000 000	41 062 932,50	1,01
VOLKSWAGEN GROUP 221121 FIX -0.49	EUR	30 000 000	30 022 066,82	0,74
TOTAL ALLEMAGNE			96 111 785,23	2,36
ESPAGNE				
FERROVIAL SA 041121 FIX -0.48	EUR	25 000 000	25 012 091,76	0,62
FERROVIAL SA 151021 FIX -0.49	EUR	20 000 000	20 004 702,62	0,49
TOTAL ESPAGNE			45 016 794,38	1,11
FRANCE				
LMA SA 251021 FIX -0.53	EUR	50 000 000	50 020 706,08	1,23
LMA ZCP 07-01-22	EUR	30 000 000	30 039 918,90	0,74
TOTAL FRANCE			80 060 624,98	1,97
IRLANDE				
ARABELLA FINANC 061021 FIX -0.4	EUR	30 000 000	30 002 501,04	0,74
ARABELLA FINANCE 081221 FIX -0.41	EUR	20 000 000	20 015 990,66	0,49
ARABELLA FINANCE 101121 FIX -0.41	EUR	25 000 000	25 011 859,55	0,61
ARABELLA FINANCE 121021 FIX -0.41	EUR	30 000 000	30 004 836,16	0,74
ARABELLA FINANCE 121121 FIX -0.41	EUR	50 000 000	50 025 811,83	1,23
ARABELLA FINANCE 131221 FIX -0.41	EUR	20 000 000	20 017 121,28	0,50
ARABELLA FINANCE 181121 FIX -0.41	EUR	45 000 000	45 025 783,69	1,11
ARABELLA FINANCE 231121 FIX -0.41	EUR	30 000 000	30 018 642,84	0,74
ARABELLA FINANCE 291021 FIX -0.41	EUR	60 000 000	60 020 899,28	1,47
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 020222 FIX -0.45	EUR	30 000 000	30 049 605,52	0,74
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 070322	EUR	30 000 000	30 063 126,11	0,74

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2021 EN EUR(suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TOTAL IRLANDE			370 256 177,96	9,11
ITALIE				
SNAM SPA 031121 FIX -0.465	EUR	50 000 000	50 022 692,98	1,23
SNAM SPA 101121 FIX -0.465	EUR	37 500 000	37 520 304,65	0,93
TOTAL ITALIE			87 542 997,63	2,16
LUXEMBOURG				
HOLCIM FINANCE REGS 140222 FIX -0.46	EUR	35 000 000	35 062 603,57	0,86
INTESA SANPAOLO 020922 FIX -0.47	EUR	15 000 000	15 066 882,78	0,37
INTESA SANPAOLO 030822 FIX -0.46	EUR	30 000 000	30 118 652,13	0,74
INTESA SANPAOLO 070322 FIX -0.42	EUR	30 000 000	30 063 126,11	0,74
INTESA SANPAOLO 110722 FIX -0.45	EUR	30 000 000	30 110 731,33	0,74
TOTAL LUXEMBOURG			140 421 995,92	3,45
PAYS-BAS				
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 111021 FIX -0.46	EUR	31 000 000	31 005 421,26	0,76
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 221021 FIX -0.46	EUR	31 000 000	31 009 113,47	0,76
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 200522 FIX -0.45	EUR	60 000 000	60 174 898,46	1,48
KONINKLIJKE FRIESLANDCAMPINA NV 151021 F	EUR	11 500 000	11 502 466,52	0,29
KONINKLIJKE FRIESLANDCAMPINA NV 301121 F	EUR	5 000 000	5 003 803,83	0,12
NATWEST MARKETS NV 300322 FIX -0.45	EUR	20 000 000	20 047 998,31	0,49
REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 010822 FIX -0.415	EUR	25 000 000	25 091 078,07	0,62
REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 301121 FIX -0.515	EUR	25 000 000	25 021 835,03	0,61
TELEFONICA EUROPE BV 081021 FIX -0.435	EUR	30 000 000	30 005 243,57	0,74
TELEFONICA EUROPE BV 101121 FIX -0.435	EUR	26 000 000	26 014 624,19	0,64
TOTAL PAYS-BAS			264 876 482,71	6,51
ROYAUME-UNI				
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC 131021 FIX	EUR	40 000 000	40 005 248,70	0,99
BAT INTERNATIONAL FINANCE PLC 201021 FIX	EUR	20 000 000	20 003 619,04	0,49
CREDIT SUISSE AG LONDON BRANCH 050722 FI	EUR	30 000 000	30 108 567,91	0,74
CREDIT SUISSE AG LONDON BRANCH 050822 FIX -0.46	EUR	30 000 000	30 117 600,15	0,74
CREDIT SUISSE AG LONDON BRANCH 060622 FIX -0.43	EUR	25 000 000	25 082 232,62	0,62
CREDIT SUISSE AG LONDON BRANCH 120822 FIX -0.46	EUR	55 000 000	55 219 956,32	1,35
NATWEST MARKETS PLC 020322 FIX -0.45	EUR	30 000 000	30 060 997,82	0,74
NATWEST MARKETS PLC 210122 FIX -0.45	EUR	9 500 000	9 514 552,38	0,23
NATWEST MARKETS PLC 280322 FIX -0.45	EUR	30 000 000	30 071 200,35	0,74
TOTAL ROYAUME-UNI			270 183 975,29	6,64
TOTAL Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé			1 354 470 834,10	33,31
TOTAL Titres de créances			3 278 964 850,54	80,64
Instrument financier à terme				

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2021 EN EUR(suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				
OISEST/0/FIX/-0.567	EUR	60 000 000	186,60	
OISEST/0.0/FIX/-0.56	EUR	40 000 000	-676,40	
OISEST/0.0/FIX/-0.56	EUR	50 000 000	345,00	
OISEST/0.0/FIX/-0.56	EUR	30 000 000	133,20	
OISEST/0.0/FIX/-0.57	EUR	25 000 000	2 088,75	
OISEST/0.0/FIX/-0.57	EUR	40 000 000	2 495,60	
OISEST/0.0/FIX/-0.57	EUR	50 000 000	3 357,50	
OISEST/0.0/FIX/-0.57	EUR	30 000 000	1 363,80	
TOTAL Swaps de taux			9 294,05	
TOTAL Autres instruments financiers à terme			9 294,05	
TOTAL Instrument financier à terme			9 294,05	
Créances			2 563 782,48	0,06
Dettes			-1 376 061,80	-0,03
Comptes financiers			529 002 059,43	13,01
Actif net			4 066 347 990,50	100,00