



29/09/2022

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	3 487 548 493,53
b) Avoirs bancaires	606 898 272,73
c) Autres actifs détenus par l'OPC	2 593 226,84
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	4 097 039 993,10
e) Passif	-1 16 897 032,98
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	3 980 142 960,12

* 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 IC en EUR	C	3 085 108 221,59	1 373 273,16810	2 246,54
GROUPAMA ENTREPRISES ID en EUR	D/R	4 140 346,99	423,1585	9 784,39
GROUPAMA ENTREPRISES M en EUR	C	191 623 999,17	186 088,55600	1 029,75
GROUPAMA ENTREPRISES N en EUR	C	423 308 639,81	764 789,33320	553,50
GROUPAMA ENTREPRISES R en EUR	C	275 961 752,56	559 925,139	492,85

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>	83,23	80,86
<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>	4,39	4,26
<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	3 487 548 493,53	87,62	85,12
TOTAL		3 487 548 493,53	87,62	85,12

* 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	49,78	48,36
PAYS-BAS	10,87	10,56
IRLANDE	5,52	5,37
ESPAGNE	5,10	4,95
ITALIE	4,77	4,63
ROYAUME-UNI	4,39	4,26
SUEDE	3,62	3,51
ALLEMAGNE	2,45	2,38
LUXEMBOURG	1,13	1,10
TOTAL	87,62	85,12

* 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.	22 643 892 241,16	21 769 300 000,00
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.	579 920 486,20	767 700 000,00
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.		

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 - 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

TRANSPARENCE DES OPERATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA REUTILISATION DES INSTRUMENTS FINANCIERS - REGLEMENT 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					
% de l'Actif Net					

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

--	--	--	--	--	--

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

--	--	--	--	--	--

e) Type et qualité des garanties (collatéral)

Type					
- Actions					
- Obligations					
- OPC					
- TCN					
- Cash	580 000,00				
Rating					
Monnaie de la garantie					
Euro	580 000,00				

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

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 à 3 mois				
3 mois à 1 an				
Plus d'1 an				
Ouvertes				

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

Moins d'1 jour				
1 jour à 1 semaine				
1 semaine à 1 mois				
1 à 3 mois				
3 mois à 1 an				
Plus d'1 an				
Ouvertes				

i) Données sur la réutilisation des garanties

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

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

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

CACEIS Bank					
Titres					
Cash	580 000,00				

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

Titres					
Cash					

l) Données sur les revenus et les coûts ventilés

Revenus					
- OPC		41,28			
- Gestionnaire					
- Tiers					
Coûts					
- OPC					
- Gestionnaire					
- Tiers					

e) Données Type et qualité des garanties (collatéral)

Groupama 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 reçues.

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

Groupama 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

Tous les revenus résultant des opérations d'acquisitions et de cessions temporaires de titres, nets des coûts opérationnels, sont restitués à l'OPC.

Les opérations de cessions temporaires de titres sont conclues avec des contreparties de marché et intermédies par Groupama Asset Management.

PORTEFEUILLE TITRES AU 29/09/2022 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				
PAYS-BAS				
VOLK INT 0.875% 16-01-23 EMTN	EUR	11 000 000	10 994 466,85	0,28
TOTAL PAYS-BAS			10 994 466,85	0,28
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			10 994 466,85	0,28
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			10 994 466,85	0,28
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ESPAGNE				
ENDESA SA 101022 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 986 425,08	0,75
ENDESA SA 261022 FIX 0.0	EUR	100 000 000	99 919 181,15	2,51
ENDESA SA 300922 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 997 083,34	1,26
TOTAL ESPAGNE			179 902 689,57	4,52
FRANCE				
ALSTOM SA 300922 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 998 725,00	0,75
BCPE INTERNATIONAL 140323 OISEST 0.17	EUR	50 000 000	50 005 448,66	1,26
BFCM (BANQUE FEDER 161222 OISEST 0.15	EUR	35 000 000	35 012 480,60	0,88
BQ PAL OISEST+0.14% 08-11-22	EUR	25 000 000	25 010 352,71	0,63
CA CON OISEST+0.14% 04-11-22	EUR	30 000 000	30 013 213,98	0,76
CA CON OISEST+0.14% 28-10-22	EUR	50 000 000	50 022 945,56	1,26
CA CON OISEST+0.145% 26-10-22	EUR	25 000 000	25 011 496,16	0,62
CARREFOUR BANQUE 241022 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 987 811,75	0,51
CARREFOUR SA 171022 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 986 896,07	0,63
CASA C OISEST+0.14% 25-10-22	EUR	30 000 000	30 012 817,92	0,75
CIC OISEST+0.15% 15-12-22	EUR	50 000 000	50 016 695,85	1,26
CIC OISEST+0.15% 19-12-22	EUR	25 000 000	25 008 318,05	0,63
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN 091122 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 965 683,40	0,62
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 111022 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 997 693,62	0,13
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 261022 FIX 0	EUR	21 000 000	20 980 419,06	0,53
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 311022 FIX 0.0	EUR	13 000 000	12 985 235,05	0,32
CREDIT MUTUEL ARKEA 231222 OISEST 0.15	EUR	30 000 000	30 010 513,42	0,75
CREDIT MUTUEL ARKEA 281122 OISEST 0.17	EUR	40 000 000	40 020 005,44	1,01
CRED L OISEST+0.14% 04-11-22	EUR	30 000 000	30 013 213,98	0,76
CRED L OISEST+0.14% 25-10-22	EUR	30 000 000	30 013 040,99	0,76
CRED M OISEST+0.14% 14-11-22	EUR	25 000 000	25 010 312,51	0,63
CRED M OISEST+0.18% 05-12-22	EUR	30 000 000	30 015 647,73	0,76

PORTEFEUILLE TITRES AU 29/09/2022 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CRED M OISEST+0.18% 13-03-23	EUR	30 000 000	30 000 485,65	0,76
DECATHLON SA 191022 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 991 891,91	0,38
DECATHLON SA 311022 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 992 450,15	0,25
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 041022 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 995 675,00	0,75
ELIS SA EX HOLDELIS SA 041122 FIX 0.07	EUR	5 000 000	4 992 853,64	0,13
ELIS SA EX HOLDELIS SA 071122 FIX 0.0	EUR	13 000 000	12 980 308,82	0,32
ELIS SA EX HOLDELIS SA 101122 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 991 412,49	0,12
ENGIE OISEST+0.16% 27-10-22	EUR	30 000 000	30 002 055,03	0,76
ENGIE OISEST+0.18% 07-10-22	EUR	40 000 000	40 015 657,53	1,01
ENGIE OISEST+0.18% 24-10-22	EUR	35 000 000	35 006 549,20	0,88
ENGIE OISEST+0.21% 28-10-22	EUR	45 000 000	45 025 674,56	1,13
ENGIE SA 171022 OISEST 0.18	EUR	20 000 000	20 007 007,92	0,50
ENGIE SA 191022 OISEST 0.17	EUR	50 000 000	50 012 699,50	1,26
ENGIE SA 261022 OISEST 0.16	EUR	50 000 000	50 004 568,17	1,26
ENGIE SA 311022 OISEST 0.23	EUR	55 000 000	55 034 673,91	1,39
FAURECIA 020123 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 925 088,44	0,38
FAURECIA 031022 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 999 065,97	0,12
FAURECIA 061022 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 995 641,91	0,25
FAURECIA 201022 FIX 0.13	EUR	15 000 000	14 985 619,61	0,37
FAURECIA 250123 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 958 926,84	0,15
FAURECIA 261022 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 994 794,70	0,12
FAURECIA ZCP 09-11-22	EUR	10 000 000	9 981 755,65	0,25
FAURECIA ZCP 27-12-22	EUR	5 000 000	4 977 229,02	0,12
ICADE SA 181022 FIX 0.0	EUR	3 000 000	2 998 639,91	0,07
ILIAD SA 261022 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 985 781,12	0,38
ITM ENTREPRISES 051022 FIX 0.0	EUR	40 000 000	39 990 744,44	1,01
ITM ENTREPRISES 261022 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 980 117,65	0,50
LAGARDERE SA 171022 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 995 954,96	0,12
LAGARDERE SA 261022 FIX 0.0	EUR	23 000 000	22 976 496,01	0,58
LMA ZCP 07-10-22	EUR	30 000 000	29 992 857,32	0,76
MERCIALYS SA 240123 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 959 668,02	0,17
PSA BANQUE FRANCE 271022 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 979 962,95	0,75
RCI BANQUE 261022 FIX 0.0	EUR	40 000 000	39 972 952,94	1,00
RENAULT SA 031022 FIX 0.0	EUR	13 000 000	12 997 734,03	0,33
RENAULT SA 171022 FIX 0.0	EUR	17 500 000	17 487 020,38	0,44
RENAULT SA 251022 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 973 044,31	0,62
RENAULT SA 300922 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 998 605,56	0,51
RENAULT SA 311022 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 973 439,83	0,50
SAVENCIA SA 061022 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 994 900,80	0,50

PORTEFEUILLE TITRES AU 29/09/2022 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SAVENCIA SA 171022 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 997 476,23	0,12
SAVENCIA SA 181022 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 992 220,13	0,37
SAVENCIA SA 311022 FIX 0.0	EUR	14 000 000	13 989 430,21	0,35
SEB SA 111022 FIX 0.0	EUR	19 000 000	18 993 224,71	0,48
SEB SA 241022 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 988 400,35	0,51
UNION FINANCES GRAINS (UFG) 101022 FIX 0.0	EUR	9 800 000	9 797 216,03	0,24
UNION FINANCES GRAINS (UFG) 101022 FIX 0.0	EUR	29 500 000	29 491 535,52	0,74
UNION FINANCES GRAINS (UFG) 251022 FIX 0	EUR	10 000 000	9 993 350,60	0,25
UNION FINANCES GRAINS (UFG) 311022 FIX 0.0	EUR	12 000 000	11 990 237,72	0,30
VALEO SA 141022 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 992 634,39	0,38
VALEO SA 300922 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 999 173,61	0,51
VALEO SA 301222 FIX 0.0	EUR	26 000 000	25 899 485,54	0,65
VALEO ZCP 22-12-22	EUR	25 000 000	24 915 614,05	0,63
VEOL E OISEST+0.13% 17-01-23	EUR	30 000 000	29 997 513,01	0,75
VEOL E OISEST+0.135% 23-01-23	EUR	40 000 000	40 000 693,85	1,00
VEOL E OISEST+0.165% 30-11-22	EUR	40 000 000	40 011 018,77	1,00
VEOL E OISEST+0.18% 04-11-22	EUR	25 000 000	25 011 705,33	0,62
VEOL E OISEST+0.18% 18-10-22	EUR	30 000 000	30 013 509,05	0,76
VEOL E OISEST+0.185% 24-10-22	EUR	15 000 000	15 006 978,89	0,37
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 111022 OISEST 0.22	EUR	30 000 000	30 012 090,53	0,75
VICAT SA 171022 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 997 237,36	0,10
VICAT SA 201022 FIX 0.0	EUR	11 000 000	10 991 848,59	0,28
VICAT SA 281022 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 985 389,25	0,37
VICAT SA 311022 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 994 301,91	0,13
VINCI SA 300922 FIX 0.0	EUR	40 000 000	39 998 241,67	1,01
TOTAL FRANCE			1 981 289 500,66	49,78
LUXEMBOURG				
MEDIOBANCA INTERNATIONAL (LUX) 071122 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 978 900,22	0,50
TOTAL LUXEMBOURG			19 978 900,22	0,50
SUEDE				
SCANIA CV AB 251122 FIX 0.0	EUR	14 000 000	13 971 987,05	0,35
TOTAL SUEDE			13 971 987,05	0,35
TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			2 195 143 077,50	55,15
Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
CONTINENTAL AG 061022 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 994 594,17	0,51
CONTINENTAL AG 201022 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 991 213,78	0,38
E.ON SE. 131022 FIX 0.0	EUR	17 500 000	17 493 178,19	0,44

PORTEFEUILLE TITRES AU 29/09/2022 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
E.ON SE. 311022 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 987 344,25	0,37
VOLKSWAGEN LEASING GMBH 311022 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 977 350,45	0,75
TOTAL ALLEMAGNE			97 443 680,84	2,45
ESPAGNE				
FERROVIAL SA 051022 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 998 327,78	0,25
FERROVIAL SA 191022 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 996 147,49	0,18
FERROVIAL SA 271022 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 995 403,33	0,15
TOTAL ESPAGNE			22 989 878,60	0,58
IRLANDE				
ARABELLA FINAN 021122 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 949 617,55	1,25
ARABELLA FINAN 071122 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 976 142,69	0,51
ARABELLA FINAN 131022 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 987 113,60	0,75
ARABELLA FINAN 171022 FIX 0.0	EUR	45 000 000	44 974 429,20	1,13
ARABELLA FINAN 251022 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 981 502,77	0,62
ARABELLA FINAN 271022 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 959 688,41	1,26
TOTAL IRLANDE			219 828 494,22	5,52
ITALIE				
ENI SPA 261022 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 981 462,28	0,76
SNAM SPA 131022 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 989 260,84	0,62
SNAM SPA 141022 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 986 360,51	0,75
SNAM SPA 271022 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 985 158,30	0,50
SNAM SPA 271022 FIX 0.0	EUR	35 000 000	34 972 231,16	0,88
UNICREDIT SPA 211022 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 984 836,61	0,76
UNICREDIT SPA 271022 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 986 485,22	0,50
TOTAL ITALIE			189 885 794,92	4,77
LUXEMBOURG				
REPSOL EUROPE FINANCE SARL 261022 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 983 581,01	0,63
TOTAL LUXEMBOURG			24 983 581,01	0,63
PAYS-BAS				
AKZO NOBEL NV 051022 FIX 0.0	EUR	12 000 000	11 998 285,00	0,30
EDP FINANCE BV 311022 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 974 188,89	0,75
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 071022 FIX 0.0	EUR	60 000 000	59 977 265,34	1,51
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 101022 FIX	EUR	25 000 000	24 988 298,05	0,63
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 111022 FIX	EUR	30 000 000	29 985 142,40	0,76
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 121022 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 989 444,83	0,50
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 131022 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 983 296,07	0,75
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 281022 FIX 0.0	EUR	60 000 000	59 950 341,13	1,51
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 300922 FIX	EUR	30 000 000	29 998 158,33	0,75
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 021122 FIX 0.	EUR	20 000 000	19 983 191,81	0,50

PORTEFEUILLE TITRES AU 29/09/2022 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 131022 FIX 0.	EUR	50 000 000	49 980 772,48	1,26
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 230123 FIX 0.	EUR	30 000 000	29 855 722,52	0,75
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 311022 FIX 0.	EUR	25 000 000	24 979 278,63	0,62
TOTAL PAYS-BAS			421 643 385,48	10,59
ROYAUME-UNI				
CREDIT SUISSE AG LONDON BRANCH 061222 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 934 320,10	0,76
CREDIT SUISSE AG LONDON BRANCH 071122 FI	EUR	30 000 000	29 967 733,00	0,75
NATIONAL GRID PLC 181022 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 986 361,05	0,50
NATWEST MARKETS PLC 200123 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 876 808,50	0,75
SSE PLC. 261022 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 975 612,70	0,75
SSE PLC. 271022 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 983 257,30	0,51
SSE PLC. 311022 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 985 440,26	0,37
TOTAL ROYAUME-UNI			174 709 532,91	4,39
SUEDE				
VATTENFALL AB 141022 FIX 0.0	EUR	40 000 000	39 979 552,97	1,01
VATTENFALL AB 171022 FIX 0.0	EUR	40 000 000	39 976 482,40	1,00
VATTENFALL AB 191022 FIX 0.0	EUR	35 000 000	34 979 055,77	0,88
VOLVO TREASURY AB 191022 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 991 510,06	0,37
TOTAL SUEDE			129 926 601,20	3,26
TOTAL Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé			1 281 410 949,18	32,19
TOTAL Titres de créances			3 476 554 026,68	87,34
Instrument financier à terme				
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				
OISEST/0.0/FIX/0.035	EUR	25 000 000	11 977,75	
OISEST/0.0/FIX/0.035	EUR	25 000 000	11 977,75	
OISEST/0.0/FIX/0.056	EUR	10 000 000	1 075,40	
OISEST/0.0/FIX/-0.06	EUR	25 000 000	22 908,00	
OISEST/0.0/FIX/-0.10	EUR	30 000 000	8 973,00	
OISEST/0.0/FIX/0.107	EUR	17 500 000	3 715,25	
OISEST/0.0/FIX/0.130	EUR	30 000 000	8 120,70	
OISEST/0.0/FIX/0.131	EUR	6 000 000	1 696,02	
OISEST/0.0/FIX/0.135	EUR	11 000 000	2 837,12	
OISEST/0.0/FIX/0.139	EUR	5 000 000	1 839,95	
OISEST/0.0/FIX/0.141	EUR	8 000 000	2 902,16	
OISEST/0.0/FIX/0.141	EUR	30 000 000	8 270,70	
OISEST/0.0/FIX/0.142	EUR	15 000 000	5 402,40	
OISEST/0.0/FIX/0.146	EUR	50 000 000	13 209,50	

PORTEFEUILLE TITRES AU 29/09/2022 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OISEST/0.0/FIX/0.147	EUR	20 000 000	5 232,80	
OISEST/0.0/FIX/0.147	EUR	20 000 000	5 207,20	
OISEST/0.0/FIX/0.152	EUR	13 000 000	5 835,05	
OISEST/0.0/FIX/0.155	EUR	20 000 000	5 531,20	
OISEST/0.0/FIX/0.155	EUR	50 000 000	19 033,00	
OISEST/0.0/FIX/0.159	EUR	19 000 000	7 168,32	
OISEST/0.0/FIX/-0.18	EUR	19 000 000	10 644,94	
OISEST/0.0/FIX/0.191	EUR	30 000 000	12 888,90	
OISEST/0.0/FIX/0.195	EUR	40 000 000	16 768,00	0,01
OISEST/0.0/FIX/0.238	EUR	20 000 000	652,60	
OISEST/0.0/FIX/-0.24	EUR	25 000 000	12 645,75	
OISEST/0.0/FIX/0.244	EUR	5 000 000	2 075,00	
OISEST/0.0/FIX/0.263	EUR	20 000 000	4 361,40	
OISEST/0.0/FIX/0.268	EUR	50 000 000	825,00	
OISEST/0.0/FIX/0.287	EUR	13 000 000	546,65	
OISEST/0.0/FIX/0.325	EUR	5 000 000	99,20	
OISEST/0.0/FIX/0.411	EUR	30 000 000	633,30	
OISEST/0.0/FIX/-0.42	EUR	11 000 000	59 404,07	
OISEST/0.0/FIX/0.434	EUR	30 000 000	693,30	
OISEST/0.0/FIX/0.438	EUR	60 000 000	1 186,80	
OISEST/0.0/FIX/0.450	EUR	39 000 000	1 063,53	
OISEST/0.0/FIX/0.469	EUR	25 000 000	620,00	
OISEST/0.0/FIX/-0.48	EUR	50 000 000	350 180,50	0,01
OISEST/0.0/FIX/0.495	EUR	15 000 000	713,25	
TOTAL Swaps de taux			628 915,46	0,02
TOTAL Autres instruments financiers à terme			628 915,46	0,02
TOTAL Instrument financier à terme			628 915,46	0,02
Créances			1 964 311,38	0,05
Dettes			-1 116 897 032,98	-2,94
Comptes financiers			606 898 272,73	15,25
Actif net			3 980 142 960,12	100,00