



asset
management

INVESTIR,
C'EST AUSSI AGIR

91-93 BOULEVARD PASTEUR

CS61595

75015 Paris Cedex 15

T 01 53 15 70 00

WWW.CPR-AM.COM

CPR OBLIG 12 MOIS

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



RAPPORT SEMESTRIEL

EXERCICE CLOS LE 30 MARS 2023



OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

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	980 095 441,77
b) Avoirs bancaires	48 375 834,60
c) Autres actifs détenus par l'OPC	135 629 098,11
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	1 164 100 374,48
e) Passif	-38 698 614,50
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	1 125 401 759,98

* 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 OBLIG 12 MOIS I en EUR	C	1 002 442 958,44	9 498,420	105 537,86
CPR OBLIG 12 MOIS P en EUR	C	10 455 465,24	46 317,574	225,73
CPR OBLIG 12 MOIS R en EUR	C	342 941,06	3 477,704	98,61
CPR OBLIG 12 MOIS S en EUR	C	112 160 395,24	112 471,555	997,23

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.	75,88	73,36
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.	11,20	10,83
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.	8,47	8,18

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

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

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

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	980 095 441,77	87,09	84,19
TOTAL		980 095 441,77	87,09	84,19

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

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

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

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	31,27	30,23
ESPAGNE	10,85	10,49
PAYS-BAS	8,23	7,96
ETATS-UNIS	4,36	4,22
ALLEMAGNE	4,00	3,87
ITALIE	3,99	3,85
SUEDE	3,45	3,34
JAPON	3,32	3,21
ROYAUME-UNI	2,98	2,88
IRLANDE	2,94	2,84
BELGIQUE	2,34	2,26
NORVEGE	2,19	2,12
LUXEMBOURG	2,07	2,00
DANEMARK	1,57	1,52
ISLANDE	1,48	1,43
FINLANDE	1,29	1,24
AUSTRALIE	0,35	0,34
AUTRICHE	0,22	0,21
CANADA	0,20	0,19
TOTAL	87,09	84,19

* 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 **
Organismes de placement collectif		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	8,47	8,18
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	8,47	8,18

* 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

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.	113 569 170,62	468 389 600,05
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.	24 094 413,03	50 300 891,48
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.	55 909 834,00	108 024 183,80

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

Information sur les commissions de surperformance (En EUR)

	30/03/2023
Parts CPR OBLIG 12 MOIS I 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)	
Parts CPR OBLIG 12 MOIS P 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)	
Parts CPR OBLIG 12 MOIS R 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)	
Parts CPR OBLIG 12 MOIS S 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.

Au 30/09/2022 (fin de période annuelle d'observation des surperformances)

	30/03/2023
Parts CPR OBLIG 12 MOIS I Frais de gestion variables acquis (hors rachats) Pourcentage de frais de gestion variables acquis (hors rachats) (3)	
Parts CPR OBLIG 12 MOIS P Frais de gestion variables acquis (hors rachats) Pourcentage de frais de gestion variables acquis (hors rachats) (3)	

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

Au 30/09/2022 (fin de période annuelle d'observation des surperformances)

	30/03/2023
Parts CPR OBLIG 12 MOIS R	
Frais de gestion variables acquis (hors rachats)	
Pourcentage de frais de gestion variables acquis (hors rachats) (3)	
Parts CPR OBLIG 12 MOIS S	
Frais de gestion variables acquis (hors rachats)	
Pourcentage de frais de gestion variables acquis (hors rachats) (3)	

(3) par rapport à l'actif net fin de période d'observation.

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

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			1 790 992,70		
% de l'Actif Net			0,16%		

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

BANCO BILBAO VIZCAYA ARG MADRID ESPAGNE			1 790 992,70		
---	--	--	--------------	--	--

e) Type et qualité des garanties (collatéral)

Type					
- Actions					
- Obligations					
- OPC					
- TCN					
- Cash			1 794 696,33		
Rating					

Monnaie de la garantie					
Euro			1 794 696,33		

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

	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			1 790 992,70		
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					

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

CACEIS BANK FRANCE					
Titres					
Cash					

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

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

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

Titres					
Cash					

l) Données sur les revenus et les coûts ventilés

Revenus					
- OPC			162 091,13		
- Gestionnaire					
- Tiers					
Coûts					
- OPC	193 404,88		14 099,66		
- 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.

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

Portefeuille titres détaillé au 30/03/2023 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				
CMZB FRANCFORT 0.25% 16-09-24	EUR	7 000 000	6 615 432,30	0,59
CMZB FRANCFORT 1.125% 24-05-24	EUR	2 500 000	2 447 903,34	0,22
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 1.625% 16-11-23	EUR	4 500 000	4 448 420,70	0,39
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 0.25% 17-01-25	EUR	6 300 000	5 725 792,05	0,51
HENKEL AG AND COKGAA 2.625% 13-09-27	EUR	2 900 000	2 872 687,90	0,25
LEG IMMOBILIEN SE 0.375% 17-01-26	EUR	4 500 000	4 031 175,31	0,36
SCBGER 0 1/4 10/15/24	EUR	4 000 000	3 777 407,31	0,34
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 1.5% 01-10-24	EUR	14 000 000	13 699 943,18	1,22
VONOVIA SE 0.0% 16-09-24 EMTN	EUR	1 500 000	1 408 885,58	0,12
TOTAL ALLEMAGNE			45 027 647,67	4,00
AUSTRALIE				
AURI 2.0% 18-09-24 EMTN	EUR	4 000 000	3 933 943,33	0,35
TOTAL AUSTRALIE			3 933 943,33	0,35
AUTRICHE				
BAWAG BK 4.125% 18-01-27 EMTN	EUR	2 500 000	2 492 096,41	0,22
TOTAL AUTRICHE			2 492 096,41	0,22
BELGIQUE				
BELFIUS BANK 0.01% 15-10-25	EUR	4 600 000	4 180 216,88	0,37
CCBGBB 1 10/26/24	EUR	8 000 000	7 673 620,84	0,68
KBC GROUPE 0.125% 10-09-26	EUR	8 000 000	7 266 028,53	0,65
KBC GROUPE 0.625% 10-04-25	EUR	7 600 000	7 211 041,45	0,64
TOTAL BELGIQUE			26 330 907,70	2,34
CANADA				
TORONTODOMINION BANK THE 0.375% 25-04-24	EUR	2 300 000	2 229 453,93	0,20
TOTAL CANADA			2 229 453,93	0,20
DANEMARK				
COLOPLAST FINANCE BV E3R+0.75% 19-05-24	EUR	6 100 000	6 151 627,25	0,54
NYKRE 0 1/8 07/10/24	EUR	8 000 000	7 607 323,56	0,68
ORSTED 3.625% 01-03-26 EMTN	EUR	3 900 000	3 929 693,38	0,35
TOTAL DANEMARK			17 688 644,19	1,57
ESPAGNE				
AMADEUS CM 0.875% 18-09-23	EUR	4 000 000	3 968 287,61	0,35
BANCO NTANDER 1.125% 17-01-25	EUR	7 200 000	6 873 075,35	0,61
BANCO NTANDER 3.875% 16-01-28	EUR	5 600 000	5 635 925,23	0,50
BANKIA 1.0% 25-06-24 EMTN	EUR	10 700 000	10 382 824,91	0,93
BANKINTER 0.875% 05-03-24	EUR	9 200 000	8 957 123,84	0,80
BBVA 0.375% 02-10-24 EMTN	EUR	10 000 000	9 519 661,61	0,85
BBVA 1.375% 14-05-25 EMTN	EUR	10 000 000	9 628 862,55	0,86
CAIXABANK 0.375% 03-02-25 EMTN	EUR	8 200 000	7 719 739,60	0,69
CAIXABANK 0.625% 01-10-24 EMTN	EUR	13 100 000	12 510 454,17	1,11

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

Portefeuille titres détaillé au 30/03/2023 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CRITERIA CAIXAHOLDING SAU 1.375% 10-04-24	EUR	7 500 000	7 409 990,22	0,66
CRITERIA CAIXAHOLDING SAU 1.5% 10-05-23	EUR	5 000 000	5 058 409,69	0,45
IBERCAJA 3.75% 15-06-25	EUR	3 400 000	3 442 596,77	0,30
KUTXABANK 4.0% 01-02-28 EMTN	EUR	3 700 000	3 710 327,79	0,33
NT CONS FIN 0.0% 23-02-26 EMTN	EUR	10 000 000	8 892 725,10	0,79
NT CONS FIN 0.5% 14-01-27 EMTN	EUR	3 900 000	3 433 432,50	0,30
SABSM 1 5/8 03/07/24	EUR	6 000 000	5 873 207,79	0,52
SANT ISS 2.5% 18-03-25 EMTN	EUR	5 500 000	5 351 157,03	0,47
UNICAJA BAN 4.5% 30-06-25 EMTN	EUR	3 600 000	3 709 178,48	0,33
TOTAL ESPAGNE			122 076 980,24	10,85
ETATS-UNIS				
AT T 1.3% 05-09-23	EUR	12 000 000	11 984 708,12	1,06
BALL 0.875% 15-03-24	EUR	3 500 000	3 426 318,36	0,30
BECTON DICKINSON AND 0.0% 13-08-23	EUR	900 000	889 039,10	0,08
BOOKING 0.1% 08-03-25	EUR	6 100 000	5 712 209,21	0,51
GEN MILLS 1.0% 27-04-23	EUR	4 000 000	4 034 331,71	0,36
IBM INTL BUSINESS MACHINES 3.375% 06-02-27	EUR	3 330 000	3 328 063,84	0,29
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 1.75% 25-05-25	EUR	3 000 000	2 906 050,44	0,26
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 4.0% 05-04-28	EUR	3 050 000	3 046 546,39	0,27
MORGAN STANLEY CAPITAL SERVICE 0.637% 26-07-24	EUR	5 000 000	4 973 346,39	0,44
MORGAN STANLEY CAPITAL SERVICE 1.342% 23-10-26	EUR	4 000 000	3 768 714,54	0,34
MORG STAN CAP 1.75% 11-03-24	EUR	3 000 000	2 943 775,86	0,26
VF 4.125% 07-03-26 EMTN	EUR	2 100 000	2 110 531,25	0,19
TOTAL ETATS-UNIS			49 123 635,21	4,36
FINLANDE				
OP CORPORATE BANK 0.375% 19-06-24	EUR	7 500 000	7 200 429,36	0,64
OP CORPORATE BANK 2.875% 15-12-25	EUR	7 400 000	7 284 156,09	0,64
TOTAL FINLANDE			14 484 585,45	1,28
FRANCE				
ACCOR 2.5% 25-01-24	EUR	2 400 000	2 384 969,88	0,21
ALD 0.0% 23-02-24 EMTN	EUR	9 700 000	9 367 756,18	0,83
ALD 0.375% 18-07-23 EMTN	EUR	4 000 000	3 977 614,97	0,35
ALD 0.375% 19-10-23 EMTN	EUR	5 000 000	4 919 839,82	0,43
ALD 4.75% 13-10-25 EMTN	EUR	5 600 000	5 790 151,60	0,52
ARVAL SERVICE LEASE 0.875% 17-02-25	EUR	4 800 000	4 529 139,68	0,40
ARVAL SERVICE LEASE 4.125% 13-04-26	EUR	5 000 000	5 045 325,01	0,45
ARVAL SERVICE LEASE SAFRANCE COMPANY 3.375% 04-01-26	EUR	6 300 000	6 244 837,57	0,55
BFCM 1.625% 19-01-26 EMTN	EUR	9 000 000	8 499 445,73	0,76
BFCM BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL 0.01% 11-05-26	EUR	14 500 000	12 900 824,05	1,15
BFCM BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL 0.75% 08-06-26	EUR	10 000 000	9 137 942,84	0,81
BFCM BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL 3.875% 26-01-28	EUR	10 000 000	9 855 744,26	0,87
BNP PAR 0.5% 04-06-26	EUR	8 000 000	7 441 520,32	0,66
BNP PAR 1.125% 11-06-26 EMTN	EUR	10 500 000	9 721 005,84	0,86
BNP PAR 1.5% 17-11-25 EMTN	EUR	7 700 000	7 365 829,27	0,66
BNP PAR E3R+0.62% 22-05-23	EUR	6 000 000	6 020 523,54	0,53

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

Portefeuille titres détaillé au 30/03/2023 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BNP PARIBAS 0.5% 15-07-25 EMTN	EUR	5 000 000	4 793 836,48	0,43
BPCE 0.01% 14-01-27	EUR	5 400 000	4 667 410,18	0,41
BPCE 0.25% 15-01-26	EUR	10 000 000	9 086 255,49	0,80
BPCE 0.375% 02-02-26 EMTN	EUR	7 800 000	7 087 747,47	0,63
BPCE 0.625% 26-09-24 EMTN	EUR	9 600 000	9 184 017,58	0,82
BPCE 1.0% 01-04-25 EMTN	EUR	15 900 000	15 167 523,02	1,35
BPCE 1.75% 26-04-27 EMTN	EUR	5 000 000	4 690 621,80	0,42
BQ POSTALE 1.0% 16-10-24 EMTN	EUR	15 000 000	14 410 803,12	1,28
CA 1.0% 18-09-25 EMTN	EUR	5 000 000	4 727 570,51	0,42
CARMILA SAS 2.375% 16-09-24	EUR	7 500 000	7 399 393,32	0,66
CARMILA SAS 2.375% 18-09-23	EUR	4 000 000	4 007 160,44	0,36
CARREFOUR 0.875% 12-06-23 EMTN	EUR	4 000 000	4 010 335,23	0,36
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN 1.625% 10-08-25	EUR	6 000 000	5 791 680,82	0,52
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN 1.75% 03-04-23	EUR	3 400 000	3 458 847,95	0,31
ELIS EX HOLDELIS 1.75% 11-04-24	EUR	5 500 000	5 481 166,01	0,49
KERING 0.25% 13-05-23 EMTN	EUR	15 600 000	15 587 255,58	1,39
KERING 1.25% 05-05-25 EMTN	EUR	5 100 000	4 937 052,57	0,44
LAGARDERE 2.75% 13-04-23	EUR	2 700 000	2 769 961,25	0,25
L'OREAL S A E3R+0.7% 29-03-24	EUR	7 200 000	7 252 852,62	0,64
NEXANS 3.75% 08-08-23	EUR	4 500 000	4 607 639,58	0,41
PERNOD RICARD 0.0% 24-10-23	EUR	9 000 000	8 830 149,21	0,79
PSA BANQUE FRANCE 0.625% 21-06-24	EUR	12 370 000	11 986 565,96	1,07
PSA BANQUE FRANCE 0.75% 19-04-23	EUR	5 600 000	5 634 211,30	0,50
PSA BANQUE FRANCE 3.875% 19-01-26	EUR	1 300 000	1 305 150,76	0,12
RENAULT 1.0% 18-04-24 EMTN	EUR	5 000 000	4 886 326,21	0,43
RENAULT CREDIT INTL BANQUE 0.75% 10-04-23	EUR	1 500 000	1 510 240,26	0,13
RENAULT CREDIT INTL BANQUE 1.375% 08-03-24	EUR	4 000 000	3 909 852,37	0,35
SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.0000010% 12-06-23	EUR	6 600 000	6 558 686,18	0,58
SG 0.25% 08-07-27 EMTN	EUR	11 000 000	9 441 566,29	0,84
SG 1.125% 23-01-25 EMTN	EUR	18 000 000	17 172 429,42	1,52
SG 1.25% 15-02-24 EMTN	EUR	5 000 000	4 897 662,56	0,43
SODEXO 0.5% 17-01-24	EUR	5 700 000	5 578 847,93	0,49
VALEO 3.25% 22/01/24 EMTN	EUR	4 600 000	4 594 285,44	0,41
WORLDLINE 0.25% 18-09-24	EUR	14 000 000	13 316 286,59	1,19
TOTAL FRANCE			351 943 862,06	31,28
IRLANDE				
BK IRELAND GROUP 0.75% 08-07-24	EUR	3 100 000	3 089 422,17	0,27
BK IRELAND GROUP 1.375% 29-08-23	EUR	9 500 000	9 490 676,34	0,84
DELL BANK INTL DAC 1.625% 24-06-24	EUR	3 000 000	2 953 317,58	0,26
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 0.0% 16-04-24	EUR	8 000 000	7 692 749,36	0,69
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 0.5% 13-09-24	EUR	10 300 000	9 812 761,89	0,88
TOTAL IRLANDE			33 038 927,34	2,94
ISLANDE				
ISLANDSBANKI HF 0.5% 20-11-23	EUR	6 400 000	6 263 648,14	0,56
ISLANDSBANKI HF 0.75% 25-03-25	EUR	6 000 000	5 394 981,03	0,48

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

Portefeuille titres détaillé au 30/03/2023 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
LANDSBANKINN HF 1.0% 30-05-23	EUR	5 000 000	5 015 038,29	0,44
TOTAL ISLANDE			16 673 667,46	1,48
ITALIE				
AUTO PER L IT 1.625% 12-06-23	EUR	2 000 000	2 019 913,36	0,18
BANCO BPM 1.75% 24-04-23 EMTN	EUR	1 889 000	1 917 658,74	0,17
BANCO BPM 2.5% 21-06-24 EMTN	EUR	3 000 000	2 992 939,68	0,27
INTE 0.75% 04-12-24 EMTN	EUR	6 690 000	6 366 948,61	0,57
INTE 1.0% 04-07-24 EMTN	EUR	19 010 000	18 487 657,53	1,65
INTE 1.0% 19-11-26 EMTN	EUR	5 000 000	4 541 330,76	0,40
INTE 1.375% 18-01-24 EMTN	EUR	2 800 000	2 757 587,33	0,24
MEDIOBANCA CREDITO FINANZ 1.625% 07-01-25	EUR	6 000 000	5 785 237,65	0,51
TOTAL ITALIE			44 869 273,66	3,99
JAPON				
ASAHI BREWERIES 1.151% 19-09-25	EUR	3 900 000	3 683 569,40	0,33
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP 3.273% 19-09-25	EUR	12 000 000	11 981 177,69	1,06
MIZUHO FINANCIAL GROUP 0.184% 13-04-26	EUR	12 000 000	10 686 816,06	0,95
MIZUHO FINANCIAL GROUP 0.214% 07-10-25	EUR	7 071 000	6 468 254,20	0,58
NISSAN MOTOR 1.94% 15-09-23	EUR	4 500 000	4 503 710,90	0,40
TOTAL JAPON			37 323 528,25	3,32
LUXEMBOURG				
ARCELLOR MITTAL 1.0% 19-05-23	EUR	3 210 000	3 227 435,49	0,29
BECTON DICKINSON EURO FINANCE SARL 0.632% 04-06-23	EUR	13 850 000	13 862 293,75	1,23
HIGHLAND HOLDINGS SARL 0.000010% 12-11-23	EUR	3 500 000	3 421 156,52	0,30
JOHN DEERE BANK 2.5% 14-09-26	EUR	2 800 000	2 766 195,32	0,25
TOTAL LUXEMBOURG			23 277 081,08	2,07
NORVEGE				
DNB BANK A 3.625% 16-02-27	EUR	2 700 000	2 686 489,05	0,24
SPAREBANK MIDT NORGE AS 3.125% 22-12-25	EUR	10 000 000	9 856 461,91	0,88
SR BANK SPAREBANKEN ROGALAND 2.875% 20-09-25	EUR	12 200 000	12 084 690,73	1,07
TOTAL NORVEGE			24 627 641,69	2,19
PAYS-BAS				
ABB FINANCE 3.25% 16-01-27	EUR	2 700 000	2 703 420,28	0,24
ABN AMRO BK 3.625% 10-01-26	EUR	2 200 000	2 198 421,85	0,19
ANNGR 2 1/4 12/15/23	EUR	2 000 000	1 986 822,49	0,18
CITY TREA BV 2.5% 01-10-24	EUR	3 000 000	2 904 991,46	0,25
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV ZCP 17-06-24	EUR	5 160 000	4 947 749,70	0,44
ESSITY CAPITAL BV 3.0% 21-09-26	EUR	4 600 000	4 584 422,83	0,41
HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 0.25% 13-10-24	EUR	4 900 000	4 438 243,77	0,40
ING GROEP NV 0.1% 03-09-25	EUR	7 000 000	6 602 713,55	0,59
ING GROEP NV 1.25% 16-02-27	EUR	4 000 000	3 660 926,26	0,33
ING GROEP NV 2.125% 10-01-26	EUR	2 500 000	2 406 344,29	0,21
ING GROEP NV 4.875% 14-11-27	EUR	6 000 000	6 186 336,14	0,55
LEASEPLAN CORPORATION NV 0.125% 13-09-23	EUR	7 100 000	6 985 971,18	0,62
LEASEPLAN CORPORATION NV 1.0% 02-05-23	EUR	1 000 000	1 007 151,07	0,09
LSEG NETHERLANDS BV 0.0% 06-04-25	EUR	3 700 000	3 448 886,92	0,31

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

Portefeuille titres détaillé au 30/03/2023 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
RELX FINANCE BV 0.0% 18-03-24	EUR	2 000 000	1 934 926,30	0,17
REPSOL INTL FINANCE BV 0.125% 05-10-24	EUR	10 400 000	9 910 018,66	0,88
SCHLUMBERGER FINANCE BV 0.0% 15-10-24	EUR	10 870 000	10 316 691,02	0,92
SIEMENS ENERGY FINANCE BV 4.0% 05-04-26	EUR	1 800 000	1 795 212,00	0,16
VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV 4.125% 15-11-25	EUR	4 000 000	4 081 025,04	0,36
VONOVIA FINANCE BV 0.125% 06-04-23	EUR	8 700 000	8 704 877,37	0,77
WOLTERS KLUWER NV 3.0% 23-09-26	EUR	1 800 000	1 803 309,45	0,16
TOTAL PAYS-BAS			92 608 461,63	8,23
ROYAUME-UNI				
EASYJET 1.125% 18-10-23 EMTN	EUR	6 000 000	5 950 524,86	0,52
GSK CAP 0.125% 12-05-23 EMTN	EUR	3 600 000	3 593 100,46	0,32
HSBC 1.5% 04-12-24 EMTN	EUR	1 000 000	989 557,19	0,09
LLOYDS BANKING GROUP 3.5% 01-04-26	EUR	6 218 000	6 350 117,45	0,56
NATWEST GROUP 4.699% 14-03-28	EUR	3 400 000	3 423 969,35	0,31
NATWEST MKTS E3R+0.98% 13-01-26	EUR	4 800 000	4 854 481,55	0,43
NWIDE 2 04/28/27	EUR	3 000 000	2 826 468,72	0,25
SANTANDER UK GROUP 0.391% 28-02-25	EUR	5 700 000	5 493 666,11	0,49
TOTAL ROYAUME-UNI			33 481 885,69	2,97
SUEDE				
AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY 1.75% 07-02-25	EUR	5 000 000	4 671 672,48	0,42
SCANIA CV AB 0.5% 06-10-23	EUR	5 641 000	5 569 199,77	0,49
SECURITAS AB 1.125% 20-02-24	EUR	11 030 000	10 771 920,64	0,96
SHBASS 0 1/8 11/03/26	EUR	7 300 000	6 450 994,63	0,58
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 1.75% 11-11-26	EUR	3 000 000	2 815 560,49	0,25
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 3.75% 07-02-28	EUR	3 500 000	3 445 330,93	0,30
SVENSKA HANDELSBANKEN AB 3.75% 01-11-27	EUR	3 000 000	3 033 293,58	0,27
VOLVO TREASURY AB 3.5% 17-11-25	EUR	2 100 000	2 105 246,26	0,18
TOTAL SUEDE			38 863 218,78	3,45
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			980 095 441,77	87,09
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			980 095 441,77	87,09
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
CPR MONETAIRE ISR Z FCP	EUR	3 600	72 409 212,00	6,43
CPR OBLIG 6 MOIS PART I	EUR	230	22 868 900,00	2,03
TOTAL FRANCE			95 278 112,00	8,46
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			95 278 112,00	8,46
TOTAL Organismes de placement collectif			95 278 112,00	8,46
Titres donnés en pension				
NORVEGE				
DNB BANK A 3.625% 16-02-27	EUR	1 800 000	1 790 992,70	0,16
TOTAL NORVEGE			1 790 992,70	0,16
TOTAL Titres donnés en pension			1 790 992,70	0,16
Dettes représentatives des titres données en pension			-1 792 800,00	-0,16

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

Portefeuille titres détaillé au 30/03/2023 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Indemnités sur titres données en pension			-1 896,33	
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
EURO BOBL 0623	EUR	-708	-1 685 040,00	-0,15
EURO SCHATZ 0623	EUR	-3 140	-2 527 575,00	-0,22
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			-4 212 615,00	-0,37
TOTAL Engagements à terme fermes			-4 212 615,00	-0,37
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				
E6R/0.0/FIX/-0.304	EUR	10 500 000	1 064 677,78	0,10
E6R/0.0/FIX/-0.335	EUR	12 000 000	856 376,80	0,07
E6R/0.0/FIX/0.3545	EUR	95 000 000	838 192,65	0,08
E6R/0.0/FIX/-0.402	EUR	80 000 000	1 174 104,00	0,11
E6R/0.0/FIX/-0.424	EUR	12 000 000	685 166,57	0,06
E6R/0.0/FIX/-0.428	EUR	65 000 000	2 511 687,57	0,22
E6R/0.0/FIX/-0.441	EUR	60 000 000	2 082 120,00	0,18
E6R/0.0/FIX/-0.446	EUR	16 000 000	1 147 267,86	0,10
E6R/0.0/FIX/-0.451	EUR	45 000 000	1 737 201,25	0,16
E6R/0.0/FIX/-0.458	EUR	37 000 000	3 890 401,59	0,35
E6R/0.0/FIX/-0.467	EUR	20 000 000	1 128 528,39	0,10
E6R/0.0/FIX/-0.476	EUR	125 000 000	7 645 868,05	0,68
E6R/0.0/FIX/-0.493	EUR	70 000 000	1 002 975,56	0,09
E6R/0.0/FIX/0.832	EUR	70 000 000	2 130 333,34	0,19
OISEST/0.0/FIX/2.466	EUR	30 000 000	320 408,10	0,02
TOTAL Swaps de taux			28 215 309,51	2,51
TOTAL Autres instruments financiers à terme			28 215 309,51	2,51
TOTAL Instrument financier à terme			24 002 694,51	2,14
Appel de marge				
APPEL MARGE CACEIS	EUR	4 212 615	4 212 615,00	0,37
TOTAL Appel de marge			4 212 615,00	0,37
Créances			6 132 068,90	0,55
Dettes			-32 691 302,91	-2,91
Comptes financiers			48 375 834,34	4,30
Actif net			1 125 401 759,98	100,00