



30/09/2020

Fonds de droit français

**GROUPAMA INDEX
INFLATION MONDE**

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	52 517 465,62
b) Avoirs bancaires	418 930,79
c) Autres actifs détenus par l'OPC	47 164 160,04
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	100 100 556,45
e) Passif	-45 549 648,36
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	54 550 908,09

* 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 INDEX INFLATION MONDE G en EUR	C/D	15 830 150,33	1 173,382	13 491,04
GROUPAMA INDEX INFLATION MONDE IC/D en EUR	C/D	26 250 853,95	16 510,973	1 589,90
GROUPAMA INDEX INFLATION MONDE M en EUR	C	9 336 251,92	57 200,199	163,22
GROUPAMA INDEX INFLATION MONDE N en EUR	C	3 133 651,89	4 142,498	756,46

ELEMENT 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-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.	51,57	28,10
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.	44,70	24,36
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	3,09	1,68

* 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 **
Dollar Us	USD	20 581 561,60	37,73	20,56
Livre Sterling	GBP	17 513 905,83	32,11	17,50
Euro	EUR	9 932 585,66	18,21	9,92
Yen Japonnais	JPY	1 346 638,11	2,47	1,35
Dollar Australien	AUD	1 341 116,30	2,46	1,34
Dollar Canadien	CAD	1 004 016,82	1,84	1,00
Couronne Suédoise	SEK	516 696,65	0,95	0,52
Couronne Norvégienne	NOK	171 208,00	0,31	0,17
Couronne Danoise	DKK	109 736,65	0,20	0,11
TOTAL		52 517 465,62	96,27	52,46

* 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 **
ETATS-UNIS	36,75	20,03
ROYAUME-UNI	32,11	17,50
FRANCE	6,36	3,47
ITALIE	5,96	3,25
ESPAGNE	2,71	1,48
JAPON	2,47	1,35
AUSTRALIE	2,28	1,24
CANADA	1,84	1,00
PORTUGAL	1,55	0,85
SUEDE	0,95	0,52
ARABIE SAOUDITE	0,80	0,44
IRLANDE	0,48	0,26
ALLEMAGNE	0,46	0,25
PHILIPPINES	0,35	0,19
NORVEGE	0,31	0,17
POLOGNE	0,31	0,17
MEXIQUE	0,21	0,11
DANEMARK	0,20	0,11
ROUMANIE	0,17	0,09
TOTAL	96,27	52,46

* 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	3,09	1,68
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE	0,00	0,00
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés	0,00	0,00
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés	0,00	0,00
Autres organismes non européens	0,00	0,00
Autres actifs		
Autres	0,00	0,00
TOTAL	3,09	1,68

* 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. 422-1 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.	3 808 304,95	2 135 604,43
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.	1 548 909,36	1 971 430,47
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	0,00	88 389,98
E) Les autres actifs.	2 477 091,42	2 563 199,39

· DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE

Part		Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt (1) EUR	Montant brut unitaire (2) EUR
Dividendes versés				
24/07/2020	GROUPAMA INDEX INFLATION MONDE G	98,04	0,00	98,04
20/07/2020	GROUPAMA INDEX INFLATION MONDE IC/D	6,26	0,00	6,26
Dividendes à verser				
	GROUPAMA INDEX INFLATION MONDE G			
	GROUPAMA INDEX INFLATION MONDE IC/D			

(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 30/09/2020 EN EUR**

Désignation des valeurs	Devis e	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
ALLEM 0.5% 15-04-30 IND	EUR	200 000	249 394,65	0,45
TOTAL ALLEMAGNE			249 394,65	0,45
ARABIE SAOUDITE				
SAUDI INTERNATIONAL BOND 2.375% 26-10-21	USD	500 000	437 812,50	0,80
TOTAL ARABIE SAOUDITE			437 812,50	0,80
AUSTRALIE				
AUSTRALIA 2.5% 20/09/2030	AUD	273 000	268 122,90	0,49
AUSTRALIA 3% 09/25 I	AUD	1 075 000	977 744,56	1,79
TOTAL AUSTRALIE			1 245 867,46	2,28
CANADA				
CANADA 1.5% 01/12/2044 INDEX	CAD	94 000	101 207,81	0,19
CANADA 2% 01/12/2041 I	CAD	94 000	110 690,41	0,20
CANADA 3% 01/12/36 IND	CAD	219 000	294 254,66	0,53
CANADA I 4.25% 01/12/21	CAD	200 000	224 854,80	0,42
CANADIAN GOVERNMENT REAL RETURN BOND 0.5% 01-12-50	CAD	100 000	82 369,07	0,16
CANA G 1.25% 01-12-47 IND	CAD	191 000	190 640,07	0,34
TOTAL CANADA			1 004 016,82	1,84
DANEMARK				
DENMARK GOVERNMENT BOND 0.5% 15-11-29	DKK	750 000	109 736,65	0,20
TOTAL DANEMARK			109 736,65	0,20
ESPAGNE				
ROYA DESP 1.0% 30-11-30	EUR	640 000	780 329,72	1,43
SECRETARA GENERAL DEL TESORO 1.2% 31-10-40	EUR	150 000	161 392,60	0,30
SPAIN GOVERNMENT BOND 1.25% 31-10-30	EUR	50 000	55 243,91	0,10
SPAIN GOVERNMENT BOND 2.7% 31-10-48	EUR	35 000	50 352,07	0,09
SPAIN IL BOND 0.15% 30-11-23	EUR	47 000	49 789,55	0,09
SPAIN IL BOND 0.65% 30-11-27	EUR	275 000	315 995,77	0,58
SPAIN IL BOND 0.7% 30-11-33	EUR	55 000	65 197,14	0,12
TOTAL ESPAGNE			1 478 300,76	2,71
ETATS-UNIS				
INTL BK FOR RECONS DEVELOP 2.8% 12-01-22	AUD	150 000	95 248,84	0,17
TII 0 1/8 07/15/24	USD	540 000	531 700,00	0,97
UNITED STATES OF AME 0.25% IND 15/01/25	USD	950 000	946 197,35	1,74

· PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2020 EN EUR
(suite)

Désignation des valeurs	Devis e	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
UNITED STATES OF AMERICA 0.125% 15-01-30	USD	400 000	379 841,04	0,70
UNITED STATES OF AMERICA 0.25% 15-02-50	USD	90 000	91 481,93	0,17
UNITED STATES OF AMERICA 3.625% 15-04-28	USD	400 000	758 284,32	1,39
UNITED STATES TREAS INFLATION BONDS 0.125% 15-07-26	USD	448 800	448 817,41	0,82
UNITED STATES TREAS INFLATION BONDS 0.125% 15-07-30	USD	750 000	718 984,60	1,32
UNITED STATES TREAS INFLATION BONDS 0.125% 15-10-24	USD	875 000	800 014,41	1,47
UNITED STATES TREAS INFLATION BONDS 0.25% 15-07-29	USD	300 000	290 191,27	0,53
UNITED STATES TREAS INFLATION BONDS 0.75% 15-07-28	USD	320 000	325 141,18	0,60
UNITED STATES TREAS INFLATION BONDS 0.875% 15-01-29	USD	180 000	183 863,03	0,34
UNITED STATES TREAS INFLATION BONDS 0.875% 15-02-47	USD	490 900	599 200,29	1,10
UNITED STATES TREAS INFLATION BONDS 1.0% 15-02-48	USD	450 000	557 410,98	1,02
UNITED STATES TREAS INFLATION BONDS 1.0% 15-02-49	USD	295 000	362 380,98	0,66
UNIT STAT 0.125% 15-01-22 IND	USD	1 000 000	992 122,56	1,82
UNIT STAT 0.375% 15-07-25 IND	USD	970 000	981 730,47	1,80
UNIT STAT 0.625% 15-01-26 IND	USD	925 000	949 043,94	1,74
UNIT STAT 1.0% 15-02-46 IND	USD	354 000	446 541,07	0,81
UNIT STAT FIX 15-02-45 IND	USD	274 000	328 060,11	0,60
US TREASURY 0.625% 01/24	USD	1 298 900	1 308 827,85	2,40
US TREASURY I 0,125% 15/01/2023	USD	600 000	592 152,83	1,08
US TREASURY I 0,125% 15/07/2022	USD	523 700	516 449,81	0,95
US TREASURY I 0,375% 15/07/2023	USD	1 000 000	997 025,97	1,83
US TREASURY I 0,625% 15/02/2043	USD	299 200	355 056,68	0,65
US TREASURY I 0,75% 15/05/2042	USD	224 400	276 757,81	0,51
US TREASURY I 1,75% 15/01/2028	USD	655 100	844 470,17	1,54
US TREASURY I 2,125% 15/02/2040	USD	224 400	352 859,18	0,65
US TREASURY I 2,125% 15/02/2041	USD	299 200	470 598,41	0,86
US TREASURY I 2,375% 15/01/2025	USD	374 000	511 233,22	0,94
US TREASURY I 2,375% 15/01/2027	USD	794 800	1 078 357,19	1,98
US TREASURY I 2,5% 15/01/2029	USD	615 000	830 295,60	1,52
US TREASURY I 2% 15/01/2026	USD	277 300	364 881,52	0,67
US TREASURY I 3,375% 15/04/2032	USD	90 000	171 898,49	0,31
US TREASURY I 3,875% 15/04/2029	USD	200 000	391 310,09	0,72
US TREASURY INDX 1.375% 02/44	USD	149 200	201 719,29	0,37
TOTAL ETATS-UNIS			20 050 149,89	36,75
FRANCE				
CADES 1.5% i 25/07/2021	EUR	281 000	312 854,77	0,58
ETAT 3.15% 10/02	EUR	325 000	646 694,70	1,18
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.1% 01-03-29	EUR	1 215 000	1 350 384,34	2,47
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.1% 01-03-36	EUR	50 000	57 293,72	0,10
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.1% 25-07-36	EUR	47 000	57 257,12	0,11
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.1% 25-07-47	EUR	300 000	405 010,45	0,75
FRANCE OAT 1.8% 25/07/2040	EUR	163 000	312 048,31	0,57
FRENCH REP 2.1% 25-07-23 IND	EUR	50 000	61 994,58	0,11

· **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2020 EN EUR**
(suite)

Désignation des valeurs	Devis e	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
FRTR 0 1/4 07/25/24	EUR	20 000	22 392,28	0,04
OATE 1,85% 11-25072027 INDX	EUR	100 000	135 896,20	0,25
REPU FRAN 0.1% 01-03-25	EUR	100 000	108 593,76	0,20
TOTAL FRANCE			3 470 420,23	6,36
IRLANDE				
IRELAND GOVERNMENT BOND 0.2% 18-10-30	EUR	150 000	155 652,27	0,29
IRLANDE 2.0% 18-02-45	EUR	75 000	105 814,08	0,19
TOTAL IRLANDE			261 466,35	0,48
ITALIE				
BTPS 2.35 09/15/24	EUR	50 000	57 735,57	0,10
ITALIE 1.25% 15/09/32 IND	EUR	435 000	498 578,42	0,92
ITALIE 2.55% 15/09/2041	EUR	120 000	186 195,77	0,34
ITALIE BTP ei 2.35% 15/09/2035	EUR	176 000	280 951,63	0,52
ITALIE EI 2.60% 09/23	EUR	360 000	467 097,08	0,85
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.1% 15-05-23	EUR	94 000	97 382,84	0,17
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.4% 15-05-30	EUR	300 000	304 963,77	0,56
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.3% 15-05-28	EUR	400 000	451 009,36	0,83
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.65% 01-12-30	EUR	700 000	756 927,56	1,39
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.85% 01-09-49	EUR	100 000	148 413,70	0,28
TOTAL ITALIE			3 249 255,70	5,96
JAPON				
JAPA GOVT 0.1% 10-03-26 IND	JPY	164 600 000	1 346 638,11	2,47
TOTAL JAPON			1 346 638,11	2,47
MEXIQUE				
ETAT DU MEXI 3.375% 23-02-31	EUR	100 000	112 344,13	0,21
TOTAL MEXIQUE			112 344,13	0,21
NORVEGE				
NORWAY GOVERNMENT BOND 1.75% 06-09-29	NOK	1 700 000	171 208,00	0,32
TOTAL NORVEGE			171 208,00	0,32
PHILIPPINES				
PHILIPPINE GOVERNMENT INTL BOND 3.0% 01-02-28	USD	200 000	188 848,05	0,35
TOTAL PHILIPPINES			188 848,05	0,35
POLOGNE				
POLAND 3% 15-01-24 EMTN	EUR	150 000	169 368,52	0,32
TOTAL POLOGNE			169 368,52	0,32
PORTUGAL				
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 0.475% 18-10-30	EUR	250 000	256 159,32	0,47
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 1.95% 15-06-29	EUR	100 000	116 424,33	0,21
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 2.125% 17-10-28	EUR	350 000	415 264,18	0,76
PORTUGAL REPUBLIQUE 4.1% 15-02-45	EUR	35 000	59 571,93	0,11
TOTAL PORTUGAL			847 419,76	1,55
ROUMANIE				
ROUMANIE 2.875% 26-05-28	EUR	86 000	94 615,56	0,17

· **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2020 EN EUR**
(suite)

Désignation des valeurs	Devis e	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TOTAL ROUMANIE			94 615,56	0,17
ROYAUME-UNI				
1.25 I-L UK TSY 11/27	GBP	262 000	589 715,30	1,08
ANGLETERRE 0.375% 22/03/2062	GBP	210 000	753 185,46	1,39
ANGLETERRE 0.5% 22/03/2050 SERIE 3MO	GBP	170 000	545 020,57	1,00
ANGLETERRE 0.75% 22/11/2047	GBP	215 000	712 368,86	1,30
ANGLETERRE 2.50% 17/07/2024 INDEXEE	GBP	140 000	559 860,57	1,02
ANGLETERRE 4.125% 12/07/30	GBP	265 000	1 136 726,88	2,08
NTW RAIL 1.375% 22/11/37 *GBP	GBP	100 000	292 772,35	0,54
ROYAUME-UNI 0.125% 03/44 INDX	GBP	234 000	549 781,58	1,01
ROYAUME-UNI 1.125%07-221137 INDX	GBP	335 000	983 198,34	1,80
ROYAUME-UNI 1.25%05-221155 INDX	GBP	190 000	890 401,30	1,63
ROYAUME-UNI 1.25%08-221132 INDX	GBP	340 000	818 853,13	1,51
ROYAUME-UNI 2%02-260135 INDX	GBP	182 000	612 912,71	1,13
TSY 0.125% 22/03/2029	GBP	335 000	594 053,97	1,08
TSY 0.125% 22/03/2068	GBP	225 000	836 258,59	1,54
TSY 0 1/8% 2024 I/L GILT	GBP	140 000	208 092,09	0,38
TSY IL GILT 0.125% 22-03-58	GBP	300 000	863 661,15	1,58
TSY IL GILT 0.25% 22-03-52 IND	GBP	285 000	796 100,07	1,46
TSY IL GILT 0.625% 22-11-42	GBP	315 000	904 898,10	1,66
TSY IL GILT 0.75% 22-03-34 IND	GBP	230 000	507 516,81	0,93
UK TREASURY 0.625% 22/03/2040 INDEX	GBP	350 000	930 848,07	1,71
UK TSY (RPI INDEX) 0.125 18-41 10/08S	GBP	320 000	626 128,43	1,15
UNITED KINGDOM GILT INFLATION LINKED 0.125% 10-08-28	GBP	200 000	296 708,09	0,54
UNITED KINGDOM GILT INFLATION LINKED 0.125% 10-08-48	GBP	241 000	540 197,07	0,99
UNITED KINGDOM GILT INFLATION LINKED 0.125% 22-03-46	GBP	215 000	491 291,68	0,90
UNITED KINGDOM GILT INFLATION LINKED 0.125% 22-11-56	GBP	20 000	54 237,67	0,10
UNIT KING 0.125% 22-03-26 IND	GBP	231 000	343 772,20	0,63
UNIT KING 0.125% 22-11-36 IND	GBP	210 000	409 518,62	0,75
UNIT KING GIL 0.125% 22-11-65	GBP	200 000	665 826,17	1,22
TOTAL ROYAUME-UNI			17 513 905,83	32,11
SUEDE				
KINGDOM OF SWEDEN 0.125% 12-05-31	SEK	2 500 000	242 270,58	0,44
KINGDOM OF SWEDEN 0.75% 12-11-29	SEK	2 650 000	274 426,07	0,50
TOTAL SUEDE			516 696,65	0,94
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			52 517 465,62	96,27
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			52 517 465,62	96,27
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
GROUPAMA INDEX INFLATION EURO IC	EUR	945	1 686 163,50	3,09
TOTAL FRANCE			1 686 163,50	3,09

· **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2020 EN EUR**
(suite)

Désignation des valeurs	Devis e	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			1 686 163,50	3,09
TOTAL Organismes de placement collectif			1 686 163,50	3,09
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
CBOT USUL 30A 1220	USD	-3	-1 492,35	0,00
FV CBOT UST 5 1220	USD	6	719,52	0,00
LIFFE LG GILT 1220	GBP	9	-220,50	0,00
SIMEX MINIJGB 1220	JPY	6	1 705,05	0,00
XEUR FBTP BTP 1220	EUR	-3	-6 210,00	-0,01
XEUR FBTS BTP 1220	EUR	1	300,00	0,00
XEUR FGBL BUN 1220	EUR	-8	-6 590,00	-0,01
XEUR FGBM BOB 1220	EUR	18	540,00	0,00
XEUR FGBS SCH 1220	EUR	18	90,00	0,00
XEUR FOAT EUR 1220	EUR	1	120,00	0,00
XSFE XT AUSTR 1220	AUD	-5	-4 230,83	-0,01
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			-15 269,11	-0,03
TOTAL Engagements à terme fermes			-15 269,11	-0,03
Autres instruments financiers à terme				
Swaps d'inflation				
INFLAT 0.975 BNP	EUR	2 350 000	53 182,99	0,11
INFLAT 1.115 BNP	EUR	2 350 000	-85 012,99	-0,16
TOTAL Swaps d'inflation			-31 830,00	-0,05
TOTAL Autres instruments financiers à terme			-31 830,00	-0,05
TOTAL Instrument financier à terme			-47 099,11	-0,08
Appel de marge				
APPEL MARGE JP MORGA	GBP	200	220,50	0,00
APPEL MARGE JP MORGA	JPY	-211 000	-1 705,05	0,00
APPEL MARGE JP MORGA	EUR	11 495	11 495,00	0,02
APPEL MARGE JP MORGA	USD	906,54	773,07	0,00
APPEL MARGE JP MORGA	AUD	6 741,73	4 120,74	0,00
TOTAL Appel de marge			14 904,26	0,02
Créances			45 404 729,67	83,24
Dettes			-45 439 382,23	-83,30
Comptes financiers			414 126,38	0,76
Actif net			54 550 908,09	100,00