

# AMUNDI RENDEMENT PLUS

## Informations semestrielles Décembre 2016

### OPCVM de droit français

**Société de gestion :** AMUNDI ASSET MANAGEMENT

**Sous déléguataire de gestion comptable en titre :** CACEIS FUND ADMINISTRATION FRANCE

**Dépositaire :** CACEIS BANK FRANCE

**Commissaire aux comptes :** DELOITTE & ASSOCIES

*Le document périodique ne fait pas l'objet d'une certification par le Commissaire aux comptes de l'OPC.*

## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs   | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle      | % Actif Net |
|---|--------|---------------------|----------------------|-------------|
| <b>Actions et valeurs assimilées</b>  |        |                     |                      |             |
| <b>Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b> |        |                     |                      |             |
| <b>ALLEMAGNE</b>  |        |                     |                      |             |
| ADIDAS NOM.   | EUR    | 1 300               | 195 195,00           | 0,02        |
| ALLIANZ SE  | EUR    | 4 920               | 772 440,00           | 0,10        |
| BASF SE   | EUR    | 7 301               | 644 751,31           | 0,08        |
| BAYER   | EUR    | 3 449               | 341 899,37           | 0,04        |
| BMW BAYERISCHE MOTOREN WERKE  | EUR    | 1 458               | 129 397,50           | 0,02        |
| BRENNTAG AG NAMEN   | EUR    | 19 759              | 1 043 275,20         | 0,13        |
| COMMERZBANK AG  | EUR    | 705                 | 5 108,43             |             |
| CONTINENTAL AG O.N.   | EUR    | 6 027               | 1 107 159,90         | 0,14        |
| DAIMLER AG  | EUR    | 11 150              | 788 528,00           | 0,10        |
| DEUTSCHE LUFTHANSA AG   | EUR    | 22 076              | 270 872,52           | 0,03        |
| DEUTSCHE POST AG NAMEN  | EUR    | 85 645              | 2 675 121,58         | 0,35        |
| DEUTSCHE TELEKOM AG   | EUR    | 57 042              | 932 921,91           | 0,12        |
| E.ON AG NOM.  | EUR    | 56 801              | 380 566,70           | 0,05        |
| EVONIK INDUSTRIES AG  | EUR    | 10                  | 283,80               |             |
| FRESENIUS   | EUR    | 11 397              | 846 341,22           | 0,11        |
| FUCHS PETROLUB  | EUR    | 21 527              | 795 422,65           | 0,10        |
| FUCHS PETROLUB PREF.  | EUR    | 6 440               | 256 827,20           | 0,03        |
| HEIDELBERGER ZEMENT   | EUR    | 2 092               | 185 413,96           | 0,02        |
| HENKEL AG AND CO.KGAA NON VTG PRF   | EUR    | 9 670               | 1 095 127,50         | 0,14        |
| INFINEON TECHNOLOGIES   | EUR    | 4 935               | 81 476,85            | 0,01        |
| K S NOM   | EUR    | 3 072               | 69 703,68            | 0,01        |
| LANXESS AG  | EUR    | 13 061              | 814 353,35           | 0,10        |
| LINDE AG  | EUR    | 1 420               | 221 662,00           | 0,03        |
| MERCK KGA   | EUR    | 1 934               | 191 756,10           | 0,02        |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG AG   | EUR    | 2 169               | 389 660,85           | 0,05        |
| SAP SE  | EUR    | 8 947               | 740 901,07           | 0,09        |
| SCHAEFFLER AG PREF  | EUR    | 34 371              | 483 084,41           | 0,06        |
| SIEMENS AG NAMEN  | EUR    | 16 455              | 1 921 944,00         | 0,25        |
| THYSSENKRUPP AG   | EUR    | 4 610               | 104 370,40           | 0,01        |
| <b>TOTAL ALLEMAGNE</b>  |        |                     | <b>17 485 566,46</b> | <b>2,21</b> |
| <b>AUTRICHE</b>   |        |                     |                      |             |
| ERSTE GROUP BANK  | EUR    | 3 281               | 91 293,83            | 0,01        |
| OMV AG  | EUR    | 3 277               | 109 976,12           | 0,01        |
| VOEST-ALPINE AG   | EUR    | 22 035              | 821 685,15           | 0,11        |
| <b>TOTAL AUTRICHE</b>   |        |                     | <b>1 022 955,10</b>  | <b>0,13</b> |
| <b>BELGIQUE</b>   |        |                     |                      |             |
| ETABLISSEMENTS COLRUYT  | EUR    | 14 723              | 692 054,62           | 0,09        |
| KBC GROUPE  | EUR    | 2 476               | 145 663,08           | 0,02        |

## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs                  | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle     | % Actif Net |
|--|--------|---------------------|---------------------|-------------|
| PROXIMUS                                 | EUR    | 3 102               | 84 870,72           | 0,01        |
| <b>TOTAL BELGIQUE</b>                    |        |                     | <b>922 588,42</b>   | <b>0,12</b> |
| <b>ESPAGNE</b>                           |        |                     |                     |             |
| ACS, ACTIVIDADES CONS Y SERV             | EUR    | 24 286              | 729 065,72          | 0,09        |
| AMADEUS IT GROUP SA                      | EUR    | 8 432               | 364 009,44          | 0,05        |
| BANCO DE BILBAO VIZCAYA S.A.             | EUR    | 58 681              | 376 379,93          | 0,05        |
| BANCO SANTANDER S.A.                     | EUR    | 124 433             | 617 063,25          | 0,08        |
| CAIXABANK S.A.                           | EUR    | 36 149              | 113 507,86          | 0,01        |
| ENAGAS SA                                | EUR    | 49 245              | 1 188 035,63        | 0,15        |
| GRIFOLS SA SHARES A                      | EUR    | 28 211              | 532 623,68          | 0,07        |
| INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL               | EUR    | 7 787               | 252 532,41          | 0,03        |
| RED ELECTRICA DE ESPANA                  | EUR    | 37 729              | 676 292,33          | 0,09        |
| TELEFONICA                               | EUR    | 82 636              | 728 849,52          | 0,09        |
| <b>TOTAL ESPAGNE</b>                     |        |                     | <b>5 578 359,77</b> | <b>0,71</b> |
| <b>ETATS UNIS AMERIQUE</b>               |        |                     |                     |             |
| AMGEN                                    | USD    | 8 100               | 1 122 826,26        | 0,14        |
| APACHE CORP COM USD1.25                  | USD    | 2 638               | 158 742,70          | 0,02        |
| AT&T INC NEW                             | USD    | 7 872               | 317 417,55          | 0,04        |
| AUTOLIV                                  | USD    | 3 100               | 332 557,48          | 0,04        |
| BEST BUY COMPANY INC                     | USD    | 8 469               | 342 614,11          | 0,04        |
| BRISTOL-MYERS SQUIB                      | USD    | 12 900              | 714 743,78          | 0,09        |
| CALPINE CORP WI                          | USD    | 25 522              | 276 574,03          | 0,04        |
| CARDINAL HEALTH                          | USD    | 4 811               | 328 274,63          | 0,04        |
| CENTURYTEL INC                           | USD    | 14 571              | 328 512,33          | 0,04        |
| CHEVRONTEXACO CORP                       | USD    | 3 202               | 357 312,54          | 0,05        |
| CISCO SYSTEMS                            | USD    | 10 294              | 294 936,89          | 0,04        |
| CONOCOPHILLIPS                           | USD    | 7 914               | 376 210,44          | 0,05        |
| DELTA AIR LINES                          | USD    | 8 371               | 390 395,34          | 0,05        |
| DICK'S SPORTING GOODS INC                | USD    | 5 600               | 281 924,63          | 0,04        |
| DISCOVERY COMM SERIES A                  | USD    | 12 986              | 337 469,79          | 0,04        |
| EASTMAN CHEMICAL CO                      | USD    | 4 989               | 355 745,62          | 0,05        |
| ELI LILLY & CO                           | USD    | 11 300              | 787 973,45          | 0,10        |
| ENTERGY CORP                             | USD    | 4 098               | 285 451,59          | 0,04        |
| EXELON CORP                              | USD    | 9 500               | 319 653,95          | 0,04        |
| EXPRESS SCRIPTS HOLDINGS CO.             | USD    | 4 615               | 300 986,82          | 0,04        |
| FLUOR CORP NEW                           | USD    | 6 279               | 312 655,21          | 0,04        |
| FRONTIER COMMUNICATIONS CORP CATEGORIE B | USD    | 105 277             | 337 365,50          | 0,04        |
| GOODYEAR TIRE & RUBBER CO                | USD    | 10 573              | 309 446,32          | 0,04        |
| HCA HOLDINGS                             | USD    | 4 260               | 298 957,29          | 0,04        |
| HENRY SCHEIN INC                         | USD    | 7 900               | 1 136 296,75        | 0,14        |
| HP ENTERPRISE                            | USD    | 14 733              | 323 225,05          | 0,04        |
| INTEL CORP                               | USD    | 8 986               | 309 004,24          | 0,04        |

## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs                 | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle      | % Actif Net |
|---|--------|---------------------|----------------------|-------------|
| INTERNATIONAL PAPER CO                  | USD    | 6 569               | 330 458,54           | 0,04        |
| JOHNSON & JOHNSON                       | USD    | 11 400              | 1 245 218,30         | 0,16        |
| KROGER                                  | USD    | 10 417              | 340 830,22           | 0,04        |
| LEAR CORP                               | USD    | 2 800               | 351 397,01           | 0,04        |
| MARATHON                                | USD    | 7 588               | 362 224,03           | 0,05        |
| MARATHON OIL CORP                       | USD    | 20 676              | 339 323,59           | 0,04        |
| MCKESSON CORP                           | USD    | 2 134               | 284 162,41           | 0,04        |
| MICRON TECHNOLOGY INC                   | USD    | 13 870              | 288 248,78           | 0,04        |
| NETWORK APPLIANCE INC                   | USD    | 9 252               | 309 379,51           | 0,04        |
| NEW AMETHYST                            | USD    | 4 300               | 258 020,38           | 0,03        |
| NEWFIELD EXPLORATION                    | USD    | 7 243               | 278 114,72           | 0,04        |
| NEWMONT MINING                          | USD    | 8 880               | 286 837,26           | 0,04        |
| PFIZER INC                              | USD    | 26 800              | 825 279,92           | 0,10        |
| PG & E CORPORATION                      | USD    | 5 327               | 306 918,03           | 0,04        |
| SOUTHWEST AIRLINES                      | USD    | 8 441               | 398 861,76           | 0,05        |
| SOUTHWESTERN ENERGY CO                  | USD    | 26 802              | 274 944,43           | 0,03        |
| SPRINT CORP-W/I                         | USD    | 16 600              | 132 516,71           | 0,02        |
| STAPLES INC                             | USD    | 36 864              | 316 301,68           | 0,04        |
| TARGET CORP                             | USD    | 4 735               | 324 256,03           | 0,04        |
| TESORO PETROLEUM                        | USD    | 4 142               | 343 415,88           | 0,04        |
| TYSON FOODS CL A                        | USD    | 5 602               | 327 595,51           | 0,04        |
| UNITED RENTALS INC                      | USD    | 3 942               | 394 592,42           | 0,05        |
| UNITEDHEALTH GROUP INC                  | USD    | 9 500               | 1 441 460,06         | 0,17        |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES               | USD    | 2 625               | 264 752,31           | 0,03        |
| VALERO ENERGY CORP                      | USD    | 5 941               | 384 820,21           | 0,05        |
| VERIZON COMMUNICATIONS EX BELL ATLANTIC | USD    | 6 115               | 309 474,95           | 0,04        |
| VIACOM INC CL B                         | USD    | 8 869               | 295 142,83           | 0,04        |
| WHOLE FOODS MARKET INC                  | USD    | 8 707               | 253 924,93           | 0,03        |
| <b>TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE</b>        |        |                     | <b>22 305 746,70</b> | <b>2,82</b> |
| <b>FINLANDE</b>                         |        |                     |                      |             |
| ELISA COMMUNICATION OXJ - A             | EUR    | 32 721              | 1 012 060,53         | 0,13        |
| ORION CORPORATION B                     | EUR    | 16 196              | 684 928,84           | 0,09        |
| UPM-KYMMENE OY                          | EUR    | 3 663               | 85 494,42            | 0,01        |
| WAERTSILAE CORPORATION                  | EUR    | 546                 | 23 303,28            |             |
| <b>TOTAL FINLANDE</b>                   |        |                     | <b>1 805 787,07</b>  | <b>0,23</b> |
| <b>FRANCE</b>                           |        |                     |                      |             |
| AIR LIQUIDE                             | EUR    | 9 163               | 968 070,95           | 0,12        |
| ATOS                                    | EUR    | 8 487               | 850 821,75           | 0,11        |
| AXA                                     | EUR    | 250                 | 5 996,25             |             |
| BIC                                     | EUR    | 5 014               | 647 558,10           | 0,08        |
| BIOMERIEUX                              | EUR    | 1 622               | 230 161,80           | 0,03        |
| BNP PARIBAS                             | EUR    | 9 128               | 552 700,40           | 0,07        |

## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs              | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle      | % Actif Net |
|--------------------------------------|--------|---------------------|----------------------|-------------|
| BOUYGUES                             | EUR    | 17                  | 578,77               |             |
| CAP GEMINI                           | EUR    | 1 496               | 119 904,40           | 0,02        |
| CARREFOUR                            | EUR    | 31 813              | 728 199,57           | 0,09        |
| CHRISTIAN DIOR                       | EUR    | 68                  | 13 549,00            |             |
| CREDIT AGRICOLE                      | EUR    | 10 410              | 122 629,80           | 0,02        |
| DANONE                               | EUR    | 2 073               | 124 794,60           | 0,02        |
| EDF                                  | EUR    | 45 000              | 435 600,00           | 0,06        |
| EDF                                  | EUR    | 45 000              | 435 600,00           | 0,06        |
| ENGIE SA                             | EUR    | 7 473               | 90 572,76            | 0,01        |
| ESSILOR INTERNATIONAL                | EUR    | 2 661               | 285 658,35           | 0,04        |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS              | EUR    | 3 446               | 63 389,17            | 0,01        |
| ILIAD                                | EUR    | 408                 | 74 521,20            | 0,01        |
| KLEPIERRE                            | EUR    | 3 503               | 130 819,54           | 0,02        |
| LEGRAND SA                           | EUR    | 23 150              | 1 248 942,50         | 0,16        |
| L'OREAL                              | EUR    | 1 894               | 328 419,60           | 0,04        |
| LVMH (LOUIS VUITTON - MOET HENNESSY) | EUR    | 1 989               | 360 804,60           | 0,05        |
| MICHELIN CAT.B                       | EUR    | 9 609               | 1 015 671,30         | 0,13        |
| NATIXIS                              | EUR    | 10                  | 53,60                |             |
| ORANGE                               | EUR    | 50 728              | 732 258,68           | 0,09        |
| PERNOD RICARD                        | EUR    | 727                 | 74 844,65            | 0,01        |
| PEUGEOT                              | EUR    | 8 024               | 124 331,88           | 0,02        |
| PUBLICIS GROUPE SA                   | EUR    | 9 710               | 636 490,50           | 0,08        |
| SANOFI                               | EUR    | 9 562               | 735 317,80           | 0,09        |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE                | EUR    | 2 826               | 186 826,86           | 0,02        |
| SOCIETE GENERALE SA                  | EUR    | 7 252               | 338 994,74           | 0,04        |
| SODEXO / EX SODEXHO ALLIANCE         | EUR    | 4 108               | 448 593,60           | 0,06        |
| TECHNIP                              | EUR    | 4 004               | 271 511,24           | 0,03        |
| THALES                               | EUR    | 16 661              | 1 534 977,93         | 0,19        |
| TOTAL                                | EUR    | 36 624              | 1 784 321,28         | 0,22        |
| TOTAL                                | EUR    | 36 624              | 1 784 321,28         | 0,22        |
| TOTAL SA RTS 04-01-17                | EUR    | 36 672              |                      |             |
| UNIBAIL RODAMCO SE                   | EUR    | 1 560               | 353 730,00           | 0,04        |
| VALEO                                | EUR    | 5 483               | 299 426,63           | 0,04        |
| VINCI (EX SGE)                       | EUR    | 11 334              | 733 309,80           | 0,09        |
| VIVENDI                              | EUR    | 13                  | 234,72               |             |
| <b>TOTAL FRANCE</b>                  |        |                     | <b>16 680 052,40</b> | <b>2,11</b> |
| <b>IRLANDE</b>                       |        |                     |                      |             |
| MALLINCKRODT PLC - W/I               | USD    | 6 437               | 304 044,88           | 0,04        |
| <b>TOTAL IRLANDE</b>                 |        |                     | <b>304 044,88</b>    | <b>0,04</b> |
| <b>ITALIE</b>                        |        |                     |                      |             |
| ASSICURAZIONI GENERALI               | EUR    | 11 599              | 163 777,88           | 0,02        |
| ENEL SPA                             | EUR    | 250 195             | 1 047 816,66         | 0,13        |

## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs   | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle      | % Actif Net |
|---|--------|---------------------|----------------------|-------------|
| ENI SPA   | EUR    | 13 647              | 211 119,09           | 0,03        |
| INTESA SANPAOLO SPA   | EUR    | 181 946             | 441 401,00           | 0,06        |
| ITALGAS SPA   | EUR    | 7 548               | 28 214,42            |             |
| LUXOTTICA GROUP   | EUR    | 7 122               | 363 934,20           | 0,05        |
| TELECOM ITALIA ORD SPA  | EUR    | 686 711             | 574 777,11           | 0,07        |
| TERNA   | EUR    | 268 891             | 1 170 213,63         | 0,15        |
| UNICREDITO RAGGRUPAMENTO  | EUR    | 53                  | 144,90               |             |
| <b>TOTAL ITALIE</b>   |        |                     | <b>4 001 398,89</b>  | <b>0,51</b> |
| <b>LUXEMBOURG</b>   |        |                     |                      |             |
| ARCELORMITTAL S.A.  | EUR    | 97 142              | 681 548,27           | 0,09        |
| RTL GROUP SA  | EUR    | 1 099               | 76 633,27            | 0,01        |
| <b>TOTAL LUXEMBOURG</b>   |        |                     | <b>758 181,54</b>    | <b>0,10</b> |
| <b>PAYS-BAS</b>   |        |                     |                      |             |
| AEGON   | EUR    | 10                  | 52,28                |             |
| AIRBUS GROUP  | EUR    | 3 330               | 209 257,20           | 0,03        |
| AKZO NOBEL  | EUR    | 1 514               | 89 916,46            | 0,01        |
| ASML HOLDING NV   | EUR    | 3 341               | 356 317,65           | 0,05        |
| FIAT INVESTMENTS NV   | EUR    | 72 210              | 625 699,65           | 0,08        |
| ING GROEP NV  | EUR    | 33 783              | 451 678,71           | 0,06        |
| KONINKLIJKE AHOLD NV  | EUR    | 46 021              | 921 800,63           | 0,12        |
| LYONDELLBASELL INDUSTRIES A   | USD    | 4 156               | 337 996,38           | 0,04        |
| NXP SEMICONDUCTO  | USD    | 1 800               | 167 260,49           | 0,02        |
| REED ELSEVIER   | EUR    | 6 934               | 110 874,66           | 0,01        |
| ROYAL PHILIPS   | EUR    | 4 140               | 120 060,00           | 0,02        |
| UNILEVER  | EUR    | 35 815              | 1 400 903,73         | 0,17        |
| WOLTERS KLUWER  | EUR    | 30 850              | 1 061 857,00         | 0,13        |
| <b>TOTAL PAYS-BAS</b>   |        |                     | <b>5 853 674,84</b>  | <b>0,74</b> |
| <b>PORTUGAL</b>   |        |                     |                      |             |
| JERONIMO MARTINS  | EUR    | 12 977              | 191 280,98           | 0,02        |
| <b>TOTAL PORTUGAL</b>   |        |                     | <b>191 280,98</b>    | <b>0,02</b> |
| <b>TOTAL Actions &amp; val. ass. ng. sur marchés régl. ou ass.</b>                      |        |                     | <b>76 909 637,05</b> | <b>9,74</b> |
| <b>TOTAL Actions et valeurs assimilées</b>  |        |                     | <b>76 909 637,05</b> | <b>9,74</b> |
| <b>Obligations et valeurs assimilées</b>  |        |                     |                      |             |
| <b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b> |        |                     |                      |             |
| <b>ALLEMAGNE</b>  |        |                     |                      |             |
| ALLEM 0.1% 15-04-26 IND   | EUR    | 100 000             | 113 904,58           | 0,01        |
| ALLEMAGNE 1.50% 02/23   | EUR    | 7 500 000           | 8 452 528,28         | 1,08        |
| ALLIANZ SE 3.375% PERP  | EUR    | 1 500 000           | 1 559 450,96         | 0,20        |
| DEUT WOHN 0.875% 08-09-21 CV  | EUR    | 200 000             | 306 306,27           | 0,04        |
| FRES MEDI 1.125% 31-01-20 CV  | EUR    | 200 000             | 251 895,35           | 0,03        |
| FRESEN 0% 24/09/2019  | EUR    | 100 000             | 152 302,00           | 0,02        |

## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs           | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle      | % Actif Net |
|-----------------------------------|--------|---------------------|----------------------|-------------|
| GERMANY 0.5% 15-02-26             | EUR    | 1 901 000           | 1 977 539,17         | 0,25        |
| GERMANY 5.5% 04-01-31             | EUR    | 3 000 000           | 5 213 725,90         | 0,66        |
| HANI FINA DEUT ZCP 12-05-20 CV    | EUR    | 200 000             | 213 558,00           | 0,03        |
| MTU AERO ENGI 0.125% 17-05-23     | EUR    | 100 000             | 113 792,74           | 0,01        |
| RAG STIFTUNG ZCP 18-02-21 CV EMTN | EUR    | 400 000             | 433 432,00           | 0,05        |
| RAG STIFTUNG 0% 31-12-18 CV       | EUR    | 700 000             | 718 536,00           | 0,09        |
| <b>TOTAL ALLEMAGNE</b>            |        |                     | <b>19 506 971,25</b> | <b>2,47</b> |
| <b>AUSTRALIE</b>                  |        |                     |                      |             |
| AUSTRALIE 2.75% 21-10-19          | AUD    | 3 500 000           | 2 466 936,44         | 0,31        |
| C E3R+0.4% 21-01-20 EMTN          | EUR    | 1 700 000           | 1 707 427,58         | 0,22        |
| MACQU 1.125% 20-01-22 EMTN        | EUR    | 1 500 000           | 1 563 591,76         | 0,20        |
| <b>TOTAL AUSTRALIE</b>            |        |                     | <b>5 737 955,78</b>  | <b>0,73</b> |
| <b>AUTRICHE</b>                   |        |                     |                      |             |
| BUWOG AG 0.0% 09-09-21            | EUR    | 200 000             | 202 532,00           | 0,03        |
| <b>TOTAL AUTRICHE</b>             |        |                     | <b>202 532,00</b>    | <b>0,03</b> |
| <b>BELGIQUE</b>                   |        |                     |                      |             |
| ANHE 0.875% 17-03-22 EMTN         | EUR    | 3 700 000           | 3 826 090,78         | 0,49        |
| BEKAERT ZCP 09-06-21              | EUR    | 100 000             | 101 772,00           | 0,01        |
| <b>TOTAL BELGIQUE</b>             |        |                     | <b>3 927 862,78</b>  | <b>0,50</b> |
| <b>BERMUDES</b>                   |        |                     |                      |             |
| WEAT INTL 5.875% 01-07-21         | USD    | 105 000             | 112 114,66           | 0,01        |
| <b>TOTAL BERMUDES</b>             |        |                     | <b>112 114,66</b>    | <b>0,01</b> |
| <b>CANADA</b>                     |        |                     |                      |             |
| ALIM COUC TAR 1.875% 06-05-26     | EUR    | 1 100 000           | 1 145 238,63         | 0,14        |
| MGCN 1.9 11/24/23                 | EUR    | 1 750 000           | 1 847 936,95         | 0,24        |
| <b>TOTAL CANADA</b>               |        |                     | <b>2 993 175,58</b>  | <b>0,38</b> |
| <b>DANEMARK</b>                   |        |                     |                      |             |
| A E3R+1.6% 18-03-19 EMTN          | EUR    | 900 000             | 923 645,10           | 0,12        |
| AP MOEL 1.5% 24-11-22 EMTN        | EUR    | 1 800 000           | 1 836 449,01         | 0,23        |
| DANBNK 5 3/4 10/31/49             | EUR    | 450 000             | 474 114,24           | 0,06        |
| <b>TOTAL DANEMARK</b>             |        |                     | <b>3 234 208,35</b>  | <b>0,41</b> |
| <b>EMIRATS ARABES UNIS</b>        |        |                     |                      |             |
| AABAR 0.5% 27-03-20 EMTN          | EUR    | 300 000             | 252 767,50           | 0,03        |
| AABAR 1.0% 27-03-22 EMTN          | EUR    | 400 000             | 308 834,67           | 0,04        |
| <b>TOTAL EMIRATS ARABES UNIS</b>  |        |                     | <b>561 602,17</b>    | <b>0,07</b> |
| <b>ESPAGNE</b>                    |        |                     |                      |             |
| ABER INFR 1.375% 20-05-26         | EUR    | 3 900 000           | 3 946 832,59         | 0,50        |
| ACS ACTI F 1.625% 27-03-19 CV     | EUR    | 100 000             | 110 668,54           | 0,01        |
| B BILB VIZC ARGE 6.75% PERP       | EUR    | 1 800 000           | 1 738 536,85         | 0,22        |
| BBVASM 3 7/8 01/30/23             | EUR    | 400 000             | 497 679,16           | 0,06        |
| BCO SANTANDER 6.25% PERP          | EUR    | 1 000 000           | 939 375,00           | 0,12        |
| CAIXAB 1 11/25/17                 | EUR    | 400 000             | 402 930,74           | 0,05        |

## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs                     | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle      | % Actif Net |
|---|--------|---------------------|----------------------|-------------|
| CO ECONIMICA DELTA SA 1.0% 01-12-23         | EUR    | 100 000             | 100 455,45           | 0,01        |
| ENAGAS SA 1.25% 06-02-25 EMTN               | EUR    | 700 000             | 725 985,53           | 0,09        |
| ESPAGNE 1.6% 30-04-25                       | EUR    | 4 000 000           | 4 183 183,56         | 0,53        |
| ESPAGNE 4% 30/04/20                         | EUR    | 1 000 000           | 1 157 969,73         | 0,15        |
| IBERDROLA FINANZAS SAU 4.125%10-230320 EMTN | EUR    | 1 750 000           | 2 031 924,76         | 0,26        |
| INTL CONS AIR 0.625% 17-11-22               | EUR    | 500 000             | 445 561,20           | 0,06        |
| NH HOTELES SA 4% 11/18 CV                   | EUR    | 100 000             | 109 273,22           | 0,01        |
| SANT CON 0.75% 03-04-19 EMTN                | EUR    | 2 000 000           | 2 037 625,89         | 0,26        |
| SANT ISS 2.5% 18-03-25 EMTN                 | EUR    | 800 000             | 803 318,03           | 0,10        |
| SANTAN 4 01/24/20                           | EUR    | 1 800 000           | 2 074 243,97         | 0,26        |
| SPAI GOVE BON 1.3% 31-10-26                 | EUR    | 1 000 000           | 994 786,99           | 0,13        |
| SPAIN 2.75% 30-04-19                        | EUR    | 3 100 000           | 3 367 789,04         | 0,43        |
| SPGB 1.15 07/30/20                          | EUR    | 2 000 000           | 2 088 041,10         | 0,26        |
| SPGB 2 3/4 10/31/24                         | EUR    | 4 000 000           | 4 516 802,19         | 0,57        |
| SPGB 3.8 04/30/24                           | EUR    | 6 000 000           | 7 358 716,44         | 0,94        |
| SPGB 4.4% 10/31/23                          | EUR    | 5 000 000           | 6 221 314,38         | 0,79        |
| TELE ZCP 09-03-21 EMTN                      | EUR    | 300 000             | 299 634,00           | 0,04        |
| TELE 6.0% 24-07-17 CV EMTN                  | EUR    | 200 000             | 193 877,40           | 0,02        |
| <b>TOTAL ESPAGNE</b>                        |        |                     | <b>46 346 525,76</b> | <b>5,87</b> |
| <b>ETATS UNIS AMERIQUE</b>                  |        |                     |                      |             |
| AKAM TECH ZCP 15-02-19                      | USD    | 221 000             | 218 322,23           | 0,03        |
| ALLERGAN PLC 5.5% 01-03-18 CV               | USD    | 170                 | 123 213,59           | 0,02        |
| BIOMARIN PHARMACEUT 0.75% 10/18 CV          | USD    | 144 000             | 153 741,42           | 0,02        |
| CITR SYST 0.5% 15-04-19 CV                  | USD    | 401 000             | 440 883,93           | 0,06        |
| DISH NETWORK 3.375% 15-08-26                | USD    | 303 000             | 330 896,25           | 0,04        |
| ELEC FOR IMAG 0.75% 01-09-19                | USD    | 118 000             | 119 412,33           | 0,02        |
| ELI LILY AND 1.0% 02-06-22                  | EUR    | 2 100 000           | 2 184 883,73         | 0,28        |
| EXPEDIA 2.5% 03-06-22                       | EUR    | 2 500 000           | 2 651 208,90         | 0,34        |
| EXTR SPAC 3.125% 01-10-35 CV                | USD    | 159 000             | 159 588,77           | 0,02        |
| FLS 1 1/4 03/17/22                          | EUR    | 2 400 000           | 2 425 111,23         | 0,31        |
| G E3R+0.7% 29-05-20 EMTN                    | EUR    | 4 000 000           | 4 025 289,56         | 0,51        |
| GOLD SAC 1.375% 26-07-22 EMTN               | EUR    | 900 000             | 935 274,95           | 0,12        |
| HOLOGIC 2% 01.03.42 CONV.                   | USD    | 91 000              | 118 392,84           | 0,01        |
| INTEL CORP 3.25% 01/08/2039 CV              | USD    | 86 000              | 144 926,12           | 0,02        |
| JP MORGAN CHASE E3R+0.55% 27-01-20 EMTN     | EUR    | 2 000 000           | 2 017 226,22         | 0,26        |
| LIBE MEDI 1.375% 15-10-23                   | USD    | 130 000             | 132 876,04           | 0,02        |
| MICR TECH 1.625% 15-02-25                   | USD    | 150 000             | 186 385,93           | 0,02        |
| MORG S E3R+0.7% 19-11-19                    | EUR    | 1 400 000           | 1 413 748,47         | 0,18        |
| MORG STA 1.75% 30-01-25 EMTN                | EUR    | 1 600 000           | 1 682 348,42         | 0,21        |
| MU 2 1/8 02/15/33                           | USD    | 45 000              | 89 368,31            | 0,01        |
| NASDAQ INC 3.875% 07/06/2021                | EUR    | 300 000             | 348 770,96           | 0,04        |
| NATL GRI 0.9% 02-11-20 EMTN                 | GBP    | 100 000             | 120 280,22           | 0,02        |



## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs                         | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle      | % Actif Net |
|---|--------|---------------------|----------------------|-------------|
| SALESFORCE.COM 0.25% 01/04/18 CV                | USD    | 293 000             | 323 753,70           | 0,04        |
| TERADYNE 1.25% 15-12-23                         | USD    | 62 000              | 62 225,72            | 0,01        |
| TIME WARNER 1.95% 15-09-23                      | EUR    | 1 500 000           | 1 606 369,52         | 0,20        |
| TOL 0 1/2 09/15/32                              | USD    | 214 000             | 200 093,46           | 0,03        |
| TWITTER 1.0% 15-09-21 CV                        | USD    | 186 000             | 162 459,10           | 0,02        |
| UNIT STAT 0.125% 15-01-22 IND                   | USD    | 500 000             | 507 861,77           | 0,06        |
| UNITED STATES TREASURY NOTEBOND 1.375% 15-12-19 | USD    | 16 000 000          | 15 144 291,04        | 1,91        |
| US TREASURY 2,875% 15/05/2043                   | USD    | 8 000 000           | 7 338 673,81         | 0,92        |
| WORKDAY 0.75% 15-07-18 CV                       | USD    | 152 000             | 151 581,72           | 0,02        |
| ZILLOW 2.0% 01-12-21                            | USD    | 17 000              | 16 634,54            |             |
| <b>TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE</b>                |        |                     | <b>45 536 094,80</b> | <b>5,77</b> |
| <b>FRANCE</b>                                   |        |                     |                      |             |
| ACAFP 0 7/8 01/19/22                            | EUR    | 1 500 000           | 1 548 692,79         | 0,20        |
| AFFP 2.03 02/23 CV                              | EUR    | 31 491              | 329 710,77           | 0,04        |
| AFFP 3 7/8 06/18/21                             | EUR    | 1 000 000           | 1 061 282,05         | 0,13        |
| AIR FRANCEKLM 3.75% 12-10-22                    | EUR    | 5 300 000           | 5 391 088,12         | 0,69        |
| AXASA 3 7/8 05/20/49                            | EUR    | 1 000 000           | 1 038 391,64         | 0,13        |
| BIM 2.5% 13-11-20 CV                            | EUR    | 3 194               | 87 461,30            | 0,01        |
| BNP EURIBOR 3 MOIS REV +0.55 20/05/2019         | EUR    | 2 500 000           | 2 523 119,58         | 0,32        |
| BNP PARIBAS 2.375% 17-02-25 EMTN                | EUR    | 3 000 000           | 3 104 761,07         | 0,39        |
| BNP 2.875% 20/03/2026                           | EUR    | 800 000             | 852 502,90           | 0,11        |
| BPCE 2.25% 27-01-20                             | USD    | 2 000 000           | 1 902 502,96         | 0,24        |
| BPCE 4.625% 18/07/23                            | EUR    | 1 200 000           | 1 438 785,04         | 0,18        |
| BQ PO 3.0% 09-06-28 EMTN                        | EUR    | 2 100 000           | 2 195 921,96         | 0,28        |
| C E3R+0.68% 20-04-21 EMTN                       | EUR    | 3 000 000           | 3 027 767,33         | 0,38        |
| CA ASSURANCES 4.25% PERP                        | EUR    | 2 000 000           | 2 058 728,63         | 0,26        |
| CA ZCP 03-10-19                                 | EUR    | 3 109               | 218 254,91           | 0,03        |
| CARR 1.25% 03-06-25 EMTN                        | EUR    | 1 300 000           | 1 335 128,32         | 0,17        |
| CHRI DIOR 0.75% 24-06-21                        | EUR    | 1 700 000           | 1 726 628,05         | 0,22        |
| CRED AGRI SA 2.625% 17-03-27                    | EUR    | 1 500 000           | 1 569 498,49         | 0,20        |
| EDF 1 5/8 10/08/24                              | EUR    | 700 000             | 748 527,64           | 0,09        |
| EDF 1.0% 13-10-26 EMTN                          | EUR    | 5 200 000           | 5 017 776,33         | 0,64        |
| EDF 2.75% 10/03/2023                            | EUR    | 1 300 000           | 1 483 710,84         | 0,19        |
| EDF 4.125% PERP EMTN                            | EUR    | 700 000             | 717 337,45           | 0,09        |
| ERAMET 4.5% 06/11/20                            | EUR    | 500 000             | 486 258,77           | 0,06        |
| FAURECIA 3.625% 15-06-23                        | EUR    | 3 500 000           | 3 640 036,39         | 0,46        |
| FONC DES REG 0.875% 01/04/19 ORA                | EUR    | 4 969               | 493 704,93           | 0,06        |
| GROUPE FNAC 3.25% 30-09-23                      | EUR    | 1 700 000           | 1 760 869,44         | 0,22        |
| ILIAD 2.125% 05-12-22                           | EUR    | 1 500 000           | 1 572 218,22         | 0,20        |
| INGENICO ZCP 26/06/22 CV                        | EUR    | 1 330               | 219 850,33           | 0,03        |
| IPNFP 1 7/8 06/16/23                            | EUR    | 2 400 000           | 2 463 383,67         | 0,31        |
| KLESIA PREVOYANCE 5.375% 08-12-26               | EUR    | 1 200 000           | 1 211 351,67         | 0,15        |

## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs                | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle      | % Actif Net  |
|--|--------|---------------------|----------------------|--------------|
| LA BANQUE POSTALE 2.75% TF/TV 19/11/27 | EUR    | 1 600 000           | 1 652 190,47         | 0,21         |
| LVMH MOET HENN ZCP 16-02-21 CV         | USD    | 865                 | 219 078,94           | 0,03         |
| NEX 0.125% 01-01-23 CV                 | EUR    | 2 250               | 144 686,25           | 0,02         |
| NK 2 1/2 11/26/20                      | EUR    | 2 000 000           | 2 161 017,53         | 0,27         |
| ORANGE 4.25% PERP                      | EUR    | 1 150 000           | 1 265 691,51         | 0,16         |
| PERNOD RICARD 1.5% 18-05-26            | EUR    | 2 500 000           | 2 570 746,92         | 0,33         |
| PERNOD RICARD 1.875% 28-09-23          | EUR    | 4 200 000           | 4 530 529,07         | 0,57         |
| R E3R+0.57% 27-11-17 EMTN              | EUR    | 1 550 000           | 1 555 374,71         | 0,20         |
| R E3R+0.58% 16-07-18 EMTN              | EUR    | 1 800 000           | 1 809 936,75         | 0,23         |
| RALLYE 1% 02/10/20                     | EUR    | 4 430               | 436 425,88           | 0,06         |
| RALLYE 4% 04/02/21                     | EUR    | 300 000             | 304 649,47           | 0,04         |
| RALLYE 5.25% 01-02-22 CV               | EUR    | 100 000             | 101 739,50           | 0,01         |
| RCI B 1.25% 08-06-22 EMTN              | EUR    | 2 300 000           | 2 374 498,26         | 0,30         |
| RCI BANQUE E3R+1.0% 18-03-19 EMTN      | EUR    | 4 700 000           | 4 770 965,30         | 0,60         |
| RCI BANQUE FLO 13-06-17                | EUR    | 1 500 000           | 1 503 406,17         | 0,19         |
| REXEL 3.5% 15-06-23                    | EUR    | 1 800 000           | 1 882 724,95         | 0,24         |
| SAFRAN ZCP 31-12-20 CV                 | EUR    | 4 533               | 434 429,12           | 0,06         |
| SANE STE DES 1.875% 16-03-26           | EUR    | 1 900 000           | 2 077 186,19         | 0,26         |
| SCOR 3.875% PERP                       | EUR    | 700 000             | 727 422,36           | 0,09         |
| SG 1.0% 01-04-22 EMTN                  | EUR    | 2 600 000           | 2 612 913,10         | 0,33         |
| SOCI GENE 2.5% 16-09-26                | EUR    | 1 300 000           | 1 343 773,32         | 0,17         |
| T 0.5% 02-12-22 EMTN                   | USD    | 600 000             | 593 514,42           | 0,08         |
| TECHNIP 0.875% 25-01-21                | EUR    | 300 000             | 419 480,21           | 0,05         |
| TEREOS 4.125% 16-06-23                 | EUR    | 5 000 000           | 5 248 818,49         | 0,67         |
| TOTAL SA 2.708% PERP EMTN              | EUR    | 2 200 000           | 2 168 883,86         | 0,27         |
| UBISOFT ZCP 27-09-21                   | EUR    | 1 512               | 88 406,64            | 0,01         |
| UNIB RODA SE ZCP 01-07-21 CV           | EUR    | 1 161               | 366 820,27           | 0,05         |
| VALE ELEC ET ZCP 16-06-21 EMTN         | USD    | 200 000             | 204 909,22           | 0,03         |
| VEOL ENVI ZCP 15-03-21                 | EUR    | 9 257               | 272 914,87           | 0,03         |
| VEOL 1.59% 10-01-28 EMTN               | EUR    | 1 400 000           | 1 465 830,98         | 0,19         |
| WEND INVE 2.5% 09-02-27                | EUR    | 1 300 000           | 1 364 843,29         | 0,17         |
| WEND ZCP 31-07-19 EMTN                 | EUR    | 2 816               | 159 134,98           | 0,02         |
| <b>TOTAL FRANCE</b>                    |        |                     | <b>98 058 194,59</b> | <b>12,42</b> |
| <b>GRECE</b>                           |        |                     |                      |              |
| BLAC SEA 4.875% 06-05-21 EMTN          | USD    | 3 000 000           | 2 960 170,04         | 0,37         |
| <b>TOTAL GRECE</b>                     |        |                     | <b>2 960 170,04</b>  | <b>0,37</b>  |
| <b>GUERNESEY</b>                       |        |                     |                      |              |
| CRED SUI 1.25% 14-04-22 EMTN           | EUR    | 3 200 000           | 3 235 501,15         | 0,41         |
| <b>TOTAL GUERNESEY</b>                 |        |                     | <b>3 235 501,15</b>  | <b>0,41</b>  |
| <b>HONG KONG</b>                       |        |                     |                      |              |
| BAOS HONG KONG ZCP 01-12-18 CV         | USD    | 400 000             | 380 169,71           | 0,05         |
| <b>TOTAL HONG KONG</b>                 |        |                     | <b>380 169,71</b>    | <b>0,05</b>  |

## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs                   | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle      | % Actif Net |
|---|--------|---------------------|----------------------|-------------|
| <b>HONGRIE</b>                            |        |                     |                      |             |
| HUSTHO 3 3/8 04/02/19 CV                  | EUR    | 400 000             | 472 502,11           | 0,06        |
| <b>TOTAL HONGRIE</b>                      |        |                     | <b>472 502,11</b>    | <b>0,06</b> |
| <b>ILES CAIMANS</b>                       |        |                     |                      |             |
| CHIN OVER FIN ZCP 05-01-23 CV             | USD    | 400 000             | 379 631,19           | 0,05        |
| CTRI COM INTL 1.0% 01-07-20               | USD    | 333 000             | 325 773,99           | 0,04        |
| CTRI COM INTL 1.25% 15-09-22              | USD    | 196 000             | 179 828,49           | 0,02        |
| HTINL 2 02/13/19                          | USD    | 250 000             | 239 493,04           | 0,03        |
| SIEM INDU 2.25% 02-06-21                  | EUR    | 100 000             | 131 101,60           | 0,02        |
| VIPS 1.5% 03/15/19                        | USD    | 231 000             | 219 030,05           | 0,03        |
| <b>TOTAL ILES CAIMANS</b>                 |        |                     | <b>1 474 858,36</b>  | <b>0,19</b> |
| <b>ILES VIERGES BRITANNIQUES</b>          |        |                     |                      |             |
| CP FOODS 0.5% 22-09-21                    | USD    | 200 000             | 188 968,21           | 0,02        |
| <b>TOTAL ILES VIERGES BRITANNIQUES</b>    |        |                     | <b>188 968,21</b>    | <b>0,02</b> |
| <b>IRLANDE</b>                            |        |                     |                      |             |
| FCA BANK SPA IRISH BRANCH 1.375% 17-04-20 | EUR    | 1 500 000           | 1 550 372,26         | 0,20        |
| FGA CAPITAL IRE E3R+0.9% 17-10-17         | EUR    | 2 100 000           | 2 111 257,52         | 0,27        |
| IREL GOVE BON 1.0% 15-05-26               | EUR    | 7 000 000           | 7 205 267,81         | 0,91        |
| <b>TOTAL IRLANDE</b>                      |        |                     | <b>10 866 897,59</b> | <b>1,38</b> |
| <b>ITALIE</b>                             |        |                     |                      |             |
| ASSICURAZIONI GENERALI 4.125% 04/05/2026  | EUR    | 400 000             | 437 825,32           | 0,06        |
| AUTO PER 1.125% 04-11-21 EMTN             | EUR    | 2 700 000           | 2 801 725,27         | 0,35        |
| AUTO PER 1.75% 26-06-26 EMTN              | EUR    | 3 200 000           | 3 332 882,41         | 0,42        |
| BTPS 2 1/2 05/01/19                       | EUR    | 4 000 000           | 4 251 218,34         | 0,54        |
| BTPS 2.7 03/01/47                         | EUR    | 6 000 000           | 5 805 301,66         | 0,74        |
| BTPS 3 3/4 05/01/21                       | EUR    | 1 700 000           | 1 948 390,19         | 0,25        |
| BUONI POLIENNALI DEL TES 4% 10-20         | EUR    | 5 000 000           | 5 759 698,34         | 0,73        |
| BUONI 3.75% 01/09/2024                    | EUR    | 4 000 000           | 4 722 043,76         | 0,60        |
| CCTS EU E6M 01/11/2018                    | EUR    | 2 000 000           | 2 067 865,11         | 0,26        |
| ENELIM 5 01/15/75                         | EUR    | 500 000             | 553 207,11           | 0,07        |
| ENI ZCP 13-04-22 EMTN                     | EUR    | 300 000             | 326 007,00           | 0,04        |
| ENI 1.5% 02-02-26 EMTN                    | EUR    | 1 200 000           | 1 247 263,87         | 0,16        |
| INTE SP VITA SUB 4.75% PERP               | EUR    | 700 000             | 690 852,25           | 0,09        |
| INTE 1.125% 04-03-22                      | EUR    | 2 000 000           | 2 027 274,79         | 0,26        |
| INTE 3.928% 15-09-26 EMTN                 | EUR    | 750 000             | 779 740,01           | 0,10        |
| INTESA SANPAOLO SPA 3.625% 12/22          | EUR    | 200 000             | 237 876,58           | 0,03        |
| ITAL BUON POL 1.25% 01-12-26              | EUR    | 6 000 000           | 5 705 838,90         | 0,72        |
| ITALIE 2.5% 01-12-24                      | EUR    | 6 000 000           | 6 474 850,55         | 0,81        |
| ITALIE 3.5% 01/06/2018                    | EUR    | 3 500 000           | 3 691 339,62         | 0,47        |
| ITALIE 4.5% 01/05/2023                    | EUR    | 9 000 000           | 10 951 238,29        | 1,38        |
| TELE ITAL SPA 1.125% 26-03-22             | EUR    | 200 000             | 195 660,47           | 0,02        |
| TERNA 4.125% 17/02/2017                   | EUR    | 8 000               | 8 328,30             |             |

## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs                          | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle      | % Actif Net |
|--|--------|---------------------|----------------------|-------------|
| TITIM 3 09/30/25                                 | EUR    | 3 100 000           | 3 141 544,53         | 0,40        |
| UNICREDIT SPA 2.75% 31/01/2020                   | EUR    | 200 000             | 221 637,13           | 0,03        |
| UNICREDIT SPA 3.25% 01/21                        | EUR    | 900 000             | 1 006 945,23         | 0,13        |
| UNICREDIT 4.875% 07/03/2017                      | EUR    | 450 000             | 471 807,62           | 0,06        |
| <b>TOTAL ITALIE</b>                              |        |                     | <b>68 858 362,65</b> | <b>8,72</b> |
| <b>JAPON</b>                                     |        |                     |                      |             |
| H ZCP 30-08-19 CV                                | JPY    | 30 000 000          | 255 093,45           | 0,03        |
| IIDA GROU HOLD ZCP 18-06-20                      | JPY    | 40 000 000          | 355 468,34           | 0,05        |
| JAPA AIRP TERM ZCP 06-03-20                      | JPY    | 20 000 000          | 164 890,82           | 0,02        |
| JAPON 1.2% 20-12-34                              | JPY    | 600 000 000         | 5 501 161,27         | 0,70        |
| KANSAI PAINT ZCP 17-06-19                        | JPY    | 10 000 000          | 85 893,60            | 0,01        |
| KANSAI PAINT ZCP 17-06-22                        | JPY    | 10 000 000          | 83 776,08            | 0,01        |
| mitsui OSK LINES LTD ZCP 24/04/2018 CV           | USD    | 500 000             | 460 066,37           | 0,06        |
| NAGOYA RAILROAD ZCP 11-12-24                     | JPY    | 10 000 000          | 92 768,87            | 0,01        |
| NIPRO C ZCP 29-01-21 CV                          | JPY    | 20 000 000          | 177 703,28           | 0,02        |
| RESORTTRUST ZCP 01-12-21                         | JPY    | 30 000 000          | 254 459,41           | 0,03        |
| SHIONOGI ZCP 17-12-19                            | JPY    | 30 000 000          | 345 258,69           | 0,04        |
| SONY ZCP 30-09-22                                | JPY    | 37 000 000          | 318 693,59           | 0,04        |
| SUZUKI MOTOR ZCP 31-03-21                        | JPY    | 30 000 000          | 290 465,51           | 0,04        |
| SUZUKI MOTOR ZCP 31-03-23                        | JPY    | 20 000 000          | 195 789,66           | 0,02        |
| TAKASHIMAYA CO LTD CV 11/12/2020                 | JPY    | 10 000 000          | 85 696,08            | 0,01        |
| TEIJIN ZCP 12-12-18 CV                           | JPY    | 30 000 000          | 299 854,17           | 0,04        |
| TORA INDU INC ZCP 30-08-19 CV                    | JPY    | 50 000 000          | 475 443,99           | 0,06        |
| YAMA DENK CO L ZCP 28-06-19 CV                   | JPY    | 60 000 000          | 601 127,61           | 0,08        |
| <b>TOTAL JAPON</b>                               |        |                     | <b>10 043 610,79</b> | <b>1,27</b> |
| <b>JERSEY</b>                                    |        |                     |                      |             |
| CARI FINA 2.5% 19-12-19 CV                       | GBP    | 100 000             | 112 004,91           | 0,01        |
| <b>TOTAL JERSEY</b>                              |        |                     | <b>112 004,91</b>    | <b>0,01</b> |
| <b>LUXEMBOURG</b>                                |        |                     |                      |             |
| APERAM 0.625% 08-07-21 CV                        | USD    | 200 000             | 237 327,54           | 0,03        |
| GRAN CITY PRO 0.25% 02-03-22                     | EUR    | 100 000             | 102 434,18           | 0,01        |
| SOCIETE EUROPEENNE DES SATELLITES SA 5.625% PERP | EUR    | 2 000 000           | 2 056 854,75         | 0,26        |
| SUBSEA 7 SA 1% 05/10/17 CONV.                    | USD    | 400 000             | 377 236,76           | 0,05        |
| <b>TOTAL LUXEMBOURG</b>                          |        |                     | <b>2 773 853,23</b>  | <b>0,35</b> |
| <b>MEXIQUE</b>                                   |        |                     |                      |             |
| AMER MOVI 5.5% 17-09-18 CV                       | EUR    | 200 000             | 174 053,78           | 0,02        |
| AMXLMM 0 05/28/20                                | EUR    | 900 000             | 874 845,00           | 0,11        |
| CEME SAB DE C 4.375% 05-03-23                    | EUR    | 1 400 000           | 1 454 565,97         | 0,18        |
| ETAT DU MEXI 3.6% 30-01-25                       | USD    | 4 000 000           | 3 716 520,50         | 0,47        |
| MEXICAN BONOS 4.75% 14-06-18                     | MXN    | 1 000 000           | 4 480 745,75         | 0,57        |
| MEXICAN BONOS 6.5% 10-06-21                      | MXN    | 1 300 000           | 5 850 151,26         | 0,74        |
| PEME PET 3.75% 15-03-19 EMTN                     | EUR    | 3 200 000           | 3 473 342,47         | 0,44        |

## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs           | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle      | % Actif Net |
|-----------------------------------|--------|---------------------|----------------------|-------------|
| PEMEX 3.125% 27/11/2020           | EUR    | 950 000             | 996 621,58           | 0,13        |
| <b>TOTAL MEXIQUE</b>              |        |                     | <b>21 020 846,31</b> | <b>2,66</b> |
| <b>NORVEGE</b>                    |        |                     |                      |             |
| TELE 0.25% 20-09-19 CV EMTN       | USD    | 200 000             | 207 096,94           | 0,03        |
| <b>TOTAL NORVEGE</b>              |        |                     | <b>207 096,94</b>    | <b>0,03</b> |
| <b>PAYS-BAS</b>                   |        |                     |                      |             |
| ABN AMRO 2.875% 30/06/25 EMTN     | EUR    | 1 200 000           | 1 281 689,26         | 0,16        |
| ACSSM 2 5/8 10/22/18              | EUR    | 100 000             | 117 456,19           | 0,01        |
| ADENVX 1 1/2 11/22/22             | EUR    | 2 100 000           | 2 212 689,45         | 0,28        |
| AIRBUS GRO ZCP 14-06-21 EMTN      | EUR    | 400 000             | 441 320,00           | 0,06        |
| BAYER CAP 5.625% 22-11-19         | EUR    | 100 000             | 109 803,62           | 0,01        |
| BREN FINA BV 1.875% 02-12-22      | USD    | 250 000             | 246 099,15           | 0,03        |
| CEZ FINANCE 0% 08/17 CV           | EUR    | 100 000             | 111 934,00           | 0,01        |
| CRH FU 1.875% 09-01-24 EMTN       | EUR    | 1 100 000           | 1 194 544,74         | 0,15        |
| EURO AERO DE ZCP 01-07-22 EMTN    | EUR    | 600 000             | 618 606,00           | 0,08        |
| GEMALTO 2.125% 23-09-21           | EUR    | 1 200 000           | 1 266 462,58         | 0,16        |
| HEINEK 1.25% 10-09-21 EMTN        | EUR    | 1 750 000           | 1 832 917,40         | 0,23        |
| ING BANK 3.625% 25/02/26 EMTN     | EUR    | 600 000             | 672 176,70           | 0,09        |
| NOMURA 1 1/8 06/03/20             | EUR    | 2 000 000           | 2 059 865,21         | 0,26        |
| NXP SEMI 1.0% 01-12-19 CV         | USD    | 407 000             | 439 994,32           | 0,06        |
| QGEN 0 3/8 03/19/19               | USD    | 200 000             | 214 405,71           | 0,03        |
| RABO NEDE 5.5% PERP               | EUR    | 900 000             | 912 267,99           | 0,12        |
| REN FIN 2.5% 12-02-25 EMTN        | EUR    | 1 250 000           | 1 334 518,17         | 0,17        |
| SIEM FINA 1.05% 16-08-17          | USD    | 250 000             | 270 340,91           | 0,03        |
| TELEFONICA EUROPE 5% 12/99        | EUR    | 1 500 000           | 1 610 676,37         | 0,20        |
| ZIGGO FINANCE BV 3.75% 15/01/25   | EUR    | 1 500 000           | 1 543 631,28         | 0,20        |
| <b>TOTAL PAYS-BAS</b>             |        |                     | <b>18 491 399,05</b> | <b>2,34</b> |
| <b>POLOGNE</b>                    |        |                     |                      |             |
| POLAND 1.625% 15-01-19 EMTN       | EUR    | 10 000 000          | 10 498 996,17        | 1,33        |
| <b>TOTAL POLOGNE</b>              |        |                     | <b>10 498 996,17</b> | <b>1,33</b> |
| <b>PORTUGAL</b>                   |        |                     |                      |             |
| BRI CONC 2.0% 22-03-23 EMTN       | EUR    | 1 300 000           | 1 353 854,90         | 0,17        |
| PARPUB 3 3/4 07/05/21             | EUR    | 1 500 000           | 1 598 456,51         | 0,20        |
| PGB 2.2 10/17/22                  | EUR    | 5 000 000           | 4 963 701,37         | 0,63        |
| PORT OBRI DO 2.875% 21-07-26      | EUR    | 2 000 000           | 1 887 520,55         | 0,24        |
| PORTUGAL REPUBLIQUE 4.1% 15-02-45 | EUR    | 3 000 000           | 2 856 254,92         | 0,36        |
| PORTUGAL 4.75% 14/06/19           | EUR    | 1 300 000           | 1 465 421,44         | 0,19        |
| <b>TOTAL PORTUGAL</b>             |        |                     | <b>14 125 209,69</b> | <b>1,79</b> |
| <b>REPUBLIQUE DE COREE</b>        |        |                     |                      |             |
| KAKAO ZCP 11-05-21                | KRW    | 200 000 000         | 156 481,48           | 0,02        |
| <b>TOTAL REPUBLIQUE DE COREE</b>  |        |                     | <b>156 481,48</b>    | <b>0,02</b> |

## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs  | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle       | % Actif Net  |
|--|--------|---------------------|-----------------------|--------------|
| <b>REPUBLIQUE TOGOLAISE</b>  |        |                     |                       |              |
| BANQ OUES AFR 5.5% 06-05-21  | USD    | 3 000 000           | 2 953 069,45          | 0,37         |
| <b>TOTAL REPUBLIQUE TOGOLAISE</b>  |        |                     | <b>2 953 069,45</b>   | <b>0,37</b>  |
| <b>ROYAUME UNI</b>   |        |                     |                       |              |
| BACR 1 1/2 04/01/22  | EUR    | 2 000 000           | 2 051 898,36          | 0,26         |
| CASA LONDON 1.875% 20-12-26  | EUR    | 2 500 000           | 2 511 309,25          | 0,32         |
| CREDIT AGRICOLE LONDON 2.375% 27/11/2020   | EUR    | 700 000             | 763 222,08            | 0,10         |
| CREDIT AGRICOLE LONDON 5.5% 17/12/21   | GBP    | 700 000             | 986 616,95            | 0,12         |
| DELPHI AUTO 1.5% 10/03/25  | EUR    | 1 950 000           | 1 982 064,41          | 0,25         |
| HSBC 0.875% 06-09-24   | EUR    | 2 500 000           | 2 465 467,12          | 0,31         |
| INMARSAT 3.875% 09-09-23   | USD    | 200 000             | 201 342,10            | 0,03         |
| J SAINSBURY 1.25% 21-11-19   | GBP    | 300 000             | 362 339,52            | 0,05         |
| SANT UK PLC 2.0% 24-08-18  | USD    | 3 000 000           | 2 861 625,98          | 0,35         |
| VOD 0 11/26/20   | GBP    | 200 000             | 228 427,84            | 0,03         |
| <b>TOTAL ROYAUME UNI</b>   |        |                     | <b>14 414 313,61</b>  | <b>1,82</b>  |
| <b>TOTAL Obligations &amp; val. ass. ng. sur mar. régl. ou ass.</b>  |        |                     | <b>409 451 549,17</b> | <b>51,85</b> |
| <b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées</b>   |        |                     | <b>409 451 549,17</b> | <b>51,85</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 CASH INSTITUTIONS SRI I   | EUR    | 0,136               | 29 917,51             |              |
| AMUNDI ETF EURO HIGH YIELD LIQUID BOND IBOXX UCITS ETF   | EUR    | 19 118              | 4 000 441,50          | 0,51         |
| PORTFOLIO EQUITY SHORT EUROPE IC   | EUR    | 4 600               | 4 402 660,00          | 0,56         |
| <b>TOTAL FRANCE</b>  |        |                     | <b>8 433 019,01</b>   | <b>1,07</b>  |
| <b>LUXEMBOURG</b>  |        |                     |                       |              |
| AF BD GLB EM HARD CUR IE CAP   | EUR    | 200                 | 8 233 774,00          | 1,04         |
| AF BOND US CORPORATE IU CAP  | USD    | 15 000              | 15 136 098,60         | 1,92         |
| AMUNDI BD EURO HIGH YIELD IE C   | EUR    | 5 500               | 13 605 680,00         | 1,72         |
| AMUNDI BGELC IUC SHS IU CAPI   | USD    | 7 500               | 11 711 803,74         | 1,48         |
| AMUNDI INDEX MSCI PACIFIC ex JAPAN - IE  | EUR    | 1 800               | 3 731 166,00          | 0,47         |
| SANTANDER-LATIN AM CORP BD-I   | USD    | 3 000               | 4 741 485,85          | 0,60         |
| <b>TOTAL LUXEMBOURG</b>  |        |                     | <b>57 160 008,19</b>  | <b>7,23</b>  |
| <b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b> |        |                     | <b>65 593 027,20</b>  | <b>8,30</b>  |

## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs   | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle      | % Actif Net  |
|---|--------|---------------------|----------------------|--------------|
| <b>Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés</b>       |        |                     |                      |              |
| <b>LUXEMBOURG</b>   |        |                     |                      |              |
| STRUCTURA - DIVERSIFIED GROWTH FUND - IHE   | EUR    | 10 000              | 10 253 500,00        | 1,30         |
| <b>TOTAL LUXEMBOURG</b>   |        |                     | <b>10 253 500,00</b> | <b>1,30</b>  |
| <b>TOTAL Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés</b> |        |                     | <b>10 253 500,00</b> | <b>1,30</b>  |
| <b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>  |        |                     | <b>75 846 527,20</b> | <b>9,60</b>  |
| <b>Titres reçus en garantie</b>   |        |                     |                      |              |
| <b>OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>  |        |                     |                      |              |
| AMUNDI ETF CAC40 UCITS.C ETF DR   | EUR    | 102 340             | 6 700 803,61         | 0,85         |
| AMUNDI ETF EURO CORPORATES UCITS ETF  | EUR    | 4 000               | 858 880,00           | 0,11         |
| AMUNDI ETF FTSE EPRA EU REAL ESTATE   | EUR    | 17 341              | 5 539 235,63         | 0,70         |
| AMUNDI ETF GEMSA EU   | EUR    | 75 517              | 26 483 811,90        | 3,34         |
| AMUNDI ETF GEMSA US   | USD    | 13 000              | 4 559 357,29         | 0,58         |
| AMUNDI ETF GOV BOND LOW RATED EUROMTS IG UCITS ETF  | EUR    | 1 000               | 228 160,00           | 0,03         |
| AMUNDI ETF JPX-NIKKEI 400 UCITS ETF EUR   | EUR    | 142 439             | 16 577 050,82        | 2,10         |
| AMUNDI ETF JPX-NIKKEI 400 UCITS ETF Part JPY  | JPY    | 4 200               | 490 897,29           | 0,06         |
| AMUNDI ETF MSCI EM ASIA UCITS ETF   | USD    | 22 305              | 520 432,38           | 0,07         |
| AMUNDI ETF MSCI EUROPE EX EMU UCITS ETF   | EUR    | 22 700              | 4 836 462,00         | 0,61         |
| AMUNDI ETF MSCI EUROPE GROWTH UCITS ETF   | EUR    | 12 000              | 2 071 440,00         | 0,26         |
| AMUNDI ETF MSCI EUROPE UTILITIES UCITS ETF  | EUR    | 14 583              | 2 418 007,23         | 0,31         |
| AMUNDI ETF MSCI EUROPE VALUE FA UCITS ETF   | EUR    | 19 400              | 3 980 880,00         | 0,50         |
| AMUNDI ETF MSCI France UCITS ETF  | EUR    | 1 776               | 373 315,20           | 0,05         |
| AMUNDI ETF MSCI SWITZERLAND UCITS ETF   | EUR    | 7 000               | 1 703 800,00         | 0,22         |
| AMUNDI ETF MSCI USA UCITS ETF   | USD    | 4 000               | 998 454,61           | 0,13         |
| AMUNDI ETF MSCI WORLD LOW CARBON UCITS E  | EUR    | 25 228              | 5 282 238,64         | 0,67         |
| LYXOR ETF MSCI LATIN AMER A FCP   | EUR    | 29 743              | 715 319,15           | 0,09         |
| <b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>                                      |        |                     | <b>84 338 545,75</b> | <b>10,68</b> |
| <b>Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés</b>               |        |                     |                      |              |
| AMUNDI ETF JAPAN TOPIX EUR HEDGED DAILY UCITS ETF PART DAILY  | GBP    | 40 000              | 2 484 184,63         | 0,31         |
| AMUNDI ETF NASDAQ 100 UCITS ETF DAILY HEDGE EUR   | EUR    | 21 800              | 2 870 039,76         | 0,37         |
| <b>TOTAL Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés</b>         |        |                     | <b>5 354 224,39</b>  | <b>0,68</b>  |
| <b>Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>   |        |                     |                      |              |
| ALPHABET- A   | USD    | 31                  | 23 290,78            |              |
| AVIVA PLC   | GBP    | 500 000             | 2 849 109,65         | 0,36         |
| A2A Az./ EX AEM   | EUR    | 71                  | 87,33                |              |
| BASF SE   | EUR    | 8 680               | 766 530,80           | 0,10         |

## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs   | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle       | % Actif Net  |
|---|--------|---------------------|-----------------------|--------------|
| BOUYGUES  | EUR    | 3 682               | 125 353,69            | 0,02         |
| DAIMLER AG  | EUR    | 1 683               | 119 021,76            | 0,02         |
| DEUTSCHE POST AG NAMEN  | EUR    | 10                  | 312,35                |              |
| DEUTSCHE TELEKOM AG   | EUR    | 439                 | 7 179,85              |              |
| EIFFAGE   | EUR    | 12 295              | 814 543,75            | 0,10         |
| ENEL SPA  | EUR    | 2 712 637           | 11 360 523,76         | 1,45         |
| ENI SPA   | EUR    | 31 600              | 488 852,00            | 0,06         |
| HSBC HLDGS PLC GBP  | GBP    | 12 658              | 97 411,44             | 0,01         |
| ING GROEP NV  | EUR    | 44 000              | 588 280,00            | 0,07         |
| LAND SECURITIES PLC   | GBP    | 183 751             | 2 294 734,84          | 0,29         |
| MALLINCKRODT PLC - W/I  | USD    | 1 230               | 58 097,75             | 0,01         |
| MUENCHENER RUECKVERSICHERUNG AG   | EUR    | 22 958              | 4 124 404,70          | 0,52         |
| NATIONAL GRID TRANSCO PLC NEW   | GBP    | 718 036             | 8 004 721,86          | 1,01         |
| NESTLE NOM.   | CHF    | 39 500              | 2 691 674,44          | 0,34         |
| PING AN INS.GRP CO.CHINA H  | HKD    | 28 018              | 132 935,31            | 0,02         |
| PORSCHE A HOLDING   | EUR    | 41 694              | 2 157 247,56          | 0,27         |
| ROCHE HOLDING AG  | CHF    | 4 089               | 887 221,46            | 0,11         |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC   | GBP    | 26 200              | 688 302,48            | 0,09         |
| SHIRE   | GBP    | 94 000              | 5 158 106,84          | 0,65         |
| SWORD GROUP   | EUR    | 49 506              | 1 437 654,24          | 0,18         |
| TOTAL   | EUR    | 175                 | 8 526,00              |              |
| UNILEVER  | EUR    | 73 060              | 2 857 741,90          | 0,36         |
| <b>TOTAL Actions &amp; val. ass. ng. sur marchés régl. ou ass.</b>                      |        |                     | <b>47 741 866,54</b>  | <b>6,04</b>  |
| <b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b> |        |                     |                       |              |
| ALLEMAGNE 3% 04/07/20   | EUR    | 850 000             | 974 832,98            | 0,12         |
| TELEFO 4.9 09/25/17   | EUR    | 2 900 000           | 2 595 882,56          | 0,33         |
| VODA GROU 1.5% 25-08-17   | GBP    | 5 000 000           | 6 369 708,47          | 0,81         |
| <b>TOTAL Obligations &amp; val. ass. ng. sur mar. régl. ou ass.</b>                     |        |                     | <b>9 940 424,01</b>   | <b>1,26</b>  |
| <b>TOTAL Titres reçus en garantie</b>   |        |                     | <b>147 375 060,69</b> | <b>18,66</b> |
| <b>Créances représentatives de titres prêtés</b>  |        |                     |                       |              |
| <b>ALLEMAGNE</b>  |        |                     |                       |              |
| ALLEM 0.1% 15-04-26 IND   | EUR    | 14 900 000          | 16 971 782,22         | 2,15         |
| ALLEMAGNE 1.50% 02/23   | EUR    | 2 500 000           | 2 817 509,43          | 0,36         |
| COMMERZBANK AG  | EUR    | 12 000              | 86 952,00             | 0,01         |
| DAIMLER AG  | EUR    | 12 000              | 848 640,00            | 0,11         |
| DEUTSCHE LUFTHANSA AG   | EUR    | 20 000              | 245 400,00            | 0,03         |
| EVONIK INDUSTRIES AG  | EUR    | 29 872              | 847 767,36            | 0,11         |
| GERMANY 0.5% 15-02-26   | EUR    | 19 499 000          | 20 284 080,07         | 2,56         |
| THYSSENKRUPP AG   | EUR    | 25 000              | 566 000,00            | 0,07         |
| <b>TOTAL ALLEMAGNE</b>  |        |                     | <b>42 668 131,08</b>  | <b>5,40</b>  |



## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs          | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle      | % Actif Net |
|----------------------------------|--------|---------------------|----------------------|-------------|
| <b>AUTRICHE</b>                  |        |                     |                      |             |
| OMV AG                           | EUR    | 19 000              | 637 640,00           | 0,08        |
| <b>TOTAL AUTRICHE</b>            |        |                     | <b>637 640,00</b>    | <b>0,08</b> |
| <b>BELGIQUE</b>                  |        |                     |                      |             |
| PROXIMUS                         | EUR    | 55 000              | 1 504 800,00         | 0,19        |
| <b>TOTAL BELGIQUE</b>            |        |                     | <b>1 504 800,00</b>  | <b>0,19</b> |
| <b>ESPAGNE</b>                   |        |                     |                      |             |
| AMADEUS IT GROUP SA              | EUR    | 14 000              | 604 380,00           | 0,08        |
| GRIFOLS SA SHARES A              | EUR    | 17 000              | 320 960,00           | 0,04        |
| <b>TOTAL ESPAGNE</b>             |        |                     | <b>925 340,00</b>    | <b>0,12</b> |
| <b>ETATS UNIS AMERIQUE</b>       |        |                     |                      |             |
| APACHE CORP COM USD1.25          | USD    | 3 350               | 201 587,58           | 0,03        |
| SPRINT CORP-W/I                  | USD    | 32 200              | 257 050,49           | 0,03        |
| UNIT STAT 0.125% 15-01-22 IND    | USD    | 34 500 000          | 35 042 461,75        | 4,44        |
| US TREASURY 2,875% 15/05/2043    | USD    | 15 000 000          | 13 760 013,40        | 1,74        |
| <b>TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE</b> |        |                     | <b>49 261 113,22</b> | <b>6,24</b> |
| <b>FINLANDE</b>                  |        |                     |                      |             |
| WAERTSILAE CORPORATION           | EUR    | 25 700              | 1 096 876,00         | 0,14        |
| <b>TOTAL FINLANDE</b>            |        |                     | <b>1 096 876,00</b>  | <b>0,14</b> |
| <b>FRANCE</b>                    |        |                     |                      |             |
| AXA                              | EUR    | 19 000              | 455 715,00           | 0,06        |
| BOUYGUES                         | EUR    | 19 450              | 662 175,25           | 0,08        |
| CHRISTIAN DIOR                   | EUR    | 6 400               | 1 275 200,00         | 0,16        |
| EDF                              | EUR    | 976                 | 9 447,68             |             |
| ENGIE SA                         | EUR    | 30 000              | 363 600,00           | 0,05        |
| EUTELSAT COMMUNICATIONS          | EUR    | 35 000              | 643 825,00           | 0,08        |
| FRENCH REP 1.0% 25-11-25         | EUR    | 25 000 000          | 26 075 472,60        | 3,30        |
| MICHELIN CAT.B                   | EUR    | 500                 | 52 850,00            | 0,01        |
| NATIXIS                          | EUR    | 6 868               | 36 812,48            |             |
| PEUGEOT                          | EUR    | 35 000              | 542 325,00           | 0,07        |
| RALLYE 4% 04/02/21               | EUR    | 900 000             | 913 948,39           | 0,12        |
| VIVENDI                          | EUR    | 6 400               | 115 552,00           | 0,01        |
| <b>TOTAL FRANCE</b>              |        |                     | <b>31 146 923,40</b> | <b>3,94</b> |
| <b>ITALIE</b>                    |        |                     |                      |             |
| LUXOTTICA GROUP                  | EUR    | 9 170               | 468 587,00           | 0,06        |
| UNICREDITO RAGGRUPAMENTO         | EUR    | 40 900              | 111 820,60           | 0,01        |
| <b>TOTAL ITALIE</b>              |        |                     | <b>580 407,60</b>    | <b>0,07</b> |
| <b>PAYS-BAS</b>                  |        |                     |                      |             |
| AEGON                            | EUR    | 17 099              | 89 393,57            | 0,02        |
| FIAT INVESTMENTS NV              | EUR    | 4 050               | 35 093,25            |             |
| <b>TOTAL PAYS-BAS</b>            |        |                     | <b>124 486,82</b>    | <b>0,02</b> |

## Portefeuille titres détaillé en EUR

| Désignation des valeurs  | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle        | % Actif Net   |
|--|--------|---------------------|------------------------|---------------|
| <b>PORTUGAL</b>  |        |                     |                        |               |
| PORT OBRI DO 2.875% 21-07-26                                       | EUR    | 3 000 000           | 2 831 280,82           | 0,36          |
| PORTUGAL 4.75% 14/06/19  | EUR    | 8 000 000           | 9 017 978,08           | 1,14          |
| <b>TOTAL PORTUGAL</b>  |        |                     | <b>11 849 258,90</b>   | <b>1,50</b>   |
| <b>TOTAL Créances représentatives de titres prêtés</b>             |        |                     | <b>139 794 977,02</b>  | <b>17,70</b>  |
| <b>Indemnités sur titres prêtés</b>                                |        |                     | <b>52 772,09</b>       | <b>0,01</b>   |
| <b>Indemnités sur titres empruntés</b>                             |        |                     | <b>-0,18</b>           |               |
| <b>Dettes représentatives des titres reçus en garantie</b>         |        |                     | <b>-147 375 060,69</b> | <b>-18,66</b> |
| <b>Instruments financiers à terme</b>                              |        |                     |                        |               |
| <b>Engagements à terme ferme</b>                                   |        |                     |                        |               |
| <b>Engagements à terme ferme sur marché réglementé ou assimilé</b> |        |                     |                        |               |
| CBO CBOT USUL 3 0317   | USD    | -129                | 290 471,68             | 0,04          |
| DJES BANKS 0317  | EUR    | 1 200               | 23 400,00              |               |
| JGBL JAPAN GO 0317   | JPY    | -7                  | -4 552,08              |               |
| NK NIKKEI 225 0317   | USD    | 180                 | 593 031,52             | 0,08          |
| NYS NYL MSCI EM 0317   | USD    | 185                 | -132 642,81            | -0,02         |
| TU CBOT UST 2 0317   | USD    | 364                 | 66 366,44              | 0,01          |
| XEUR FESX DJ 0317  | EUR    | -1 100              | -993 620,00            | -0,13         |
| XEUR FGBL BUN 0317   | EUR    | -794                | -2 040 580,00          | -0,26         |
| XEUR FGBM BOB 0317   | EUR    | -161                | -141 680,00            | -0,02         |
| XEUR FGBS SCH 0317   | EUR    | -264                | -26 400,00             |               |
| <b>TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé</b>      |        |                     | <b>-2 366 205,25</b>   | <b>-0,30</b>  |
| <b>TOTAL Engagements à terme fermes</b>                            |        |                     | <b>-2 366 205,25</b>   | <b>-0,30</b>  |
| <b>TOTAL Instruments financiers à terme</b>                        |        |                     | <b>-2 366 205,25</b>   | <b>-0,30</b>  |
| <b>Appel de marge</b>  |        |                     |                        |               |
| Appels de marges C.A.Indo en \$ us                                 | USD    | -861 968,8          | -817 225,69            | -0,10         |
| Appels de marges C.A.Indo en euro                                  | EUR    | 3 178 880           | 3 178 880,00           | 0,40          |
| Appels de marges C.A.Indo en yen                                   | JPY    | 560 000             | 4 552,08               |               |
| <b>TOTAL Appel de marge</b>  |        |                     | <b>2 366 206,39</b>    | <b>0,30</b>   |
| <b>Créances</b>  |        |                     | <b>207 997 176,60</b>  | <b>26,33</b>  |
| <b>Dettes</b>  |        |                     | <b>-222 858 748,20</b> | <b>-28,22</b> |
| <b>Comptes financiers</b>  |        |                     | <b>102 632 828,46</b>  | <b>12,99</b>  |
| <b>Actif net</b>   |        |                     | <b>789 826 720,35</b>  | <b>100,00</b> |

## Informations destinées aux investisseurs suisses

L'attention des investisseurs suisses est attirée sur les informations suivantes :

### **CORRESPONDANTS EN SUISSE**

- Le Représentant en Suisse : CACEIS (Switzerland) SA,  
35 route de Signy, CH -1260 Nyon
  
- Le Service de paiement en Suisse :
  - o CA Indosuez (Switzerland) SA, Quai Général-Guisan 4, CH -1204 Genève jusqu'au 31 décembre 2016
  - o CACEIS Bank Paris, succursale de Nyon / Suisse, 35 route de Signy, CH-1260 Nyon depuis le 1<sup>er</sup> janvier 2017

Le prospectus, les informations clés pour l'investisseur, le règlement, la liste des achats et des ventes ainsi que les derniers rapports annuel et semestriel du fonds sont disponibles sur simple demande et sans frais auprès de CACEIS (Switzerland) SA, 35 route de Signy, CH 1260 Nyon.

Le lieu d'exécution et le for se trouvent au siège du représentant pour les parts distribuées en Suisse ou à partir de celle-ci.

## Publication

Les publications concernant les placements collectifs étrangers ont lieu sur la plateforme électronique [www.fundinfo.com](http://www.fundinfo.com). Les prix d'émission et de rachats, respectivement la valeur d'inventaire avec la mention « commissions non comprises » de toutes les classes de parts sont publiés lors de chaque émission et de chaque rachat de parts dans la plateforme électronique [www.fundinfo.com](http://www.fundinfo.com). Les prix sont publiés quotidiennement.

## AMUNDI RENDEMENT PLUS

### Performance nette (%)

|                                | 2016  | 2015  | 2014 | 2013 | 2012 |
|--------------------------------|-------|-------|------|------|------|
| AMUNDI RENDEMENT PLUS M (EUR)  | 1,75  | -     | -    | -    | -    |
| AMUNDI RENDEMENT PLUS I (EUR)  | 2,44  | 1,04  | 6,59 | 3,92 | 8,45 |
| AMUNDI RENDEMENT PLUS OR (EUR) | 2,69  | -     | -    | -    | -    |
| AMUNDI RENDEMENT PLUS P (EUR)  | 1,83  | 0,30  | 5,76 | 3,86 | 8,30 |
| AMUNDI RENDEMENT PLUS I2 (EUR) | 2,22  | 1,09  | 6,76 | 4,14 | 8,64 |
|                                | -0,32 | -0,11 | 1,45 | 2,33 | 8,64 |

*Conformément au prospectus, les performances sont calculées sur la base de la dernière valeur liquidative officielle du mois d'arrêté. La performance du Fonds est présentée après déduction des frais de fonctionnement et de gestion.*

*Les performances passées ne préjugent pas des performances futures. Elles ne sont pas constantes dans le temps.*

*Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais perçus lors de l'émission et du rachat de chaque action.*

## Total expense ratio au cours de la période de référence s'achevant le 30/12/2016

LE TOTAL EXPENSE RATIO - TER\* - (non audité)

TER % = [Charges d'exploitation / Fortune moyenne] x 100

| Parts                                 | I-C            | P-C            | I2-C           | M-C           | OR-D          |
|---------------------------------------|----------------|----------------|----------------|---------------|---------------|
| Isin                                  | FR0010115295   | FR0010820332   | FR0011027283   | FR0012518397  | FR0012847226  |
| Charges d'exploitation                | 1 107 705,62   | 1 549 172,78   | 726 174,09     | 552 827,01    | 74 776,69     |
| Fortune moyenne du fonds              | 275 739 044,77 | 154 612 117,39 | 117 694 400,07 | 44 156 540,88 | 59 836 273,53 |
| <b>TER</b>                            | <b>0,40%</b>   | <b>1,00%</b>   | <b>0,61%</b>   | <b>1,25%</b>  | <b>0,12%</b>  |
| Commission de surperformance          | 3 542,13       | 3 757,25       | 490 230,18     | 375 801,12    | 0,00          |
| Fortune moyenne du fonds              | 275 739 044,77 | 154 612 117,39 | 117 694 400,07 | 44 156 540,88 | 59 836 273,53 |
| <b>TER de surperformance</b>          | <b>0,00%</b>   | <b>0,00%</b>   | <b>0,41%</b>   | <b>0,85%</b>  | <b>0,00%</b>  |
| Frais de fonctionnement et de gestion | <b>0,40%</b>   | <b>1,00%</b>   | <b>0,20%</b>   | <b>0,40%</b>  | <b>0,12%</b>  |

Changement taux de frais de gestion sur la période : le taux de frais de gestion de la part OR-D est passé de 0.4 à 0.1 le 03/03/16.

\* Le TER présenté a été calculé conformément à la réglementation suisse cf. "Directive pour le calcul et la publication du TER pour les placements collectifs de capitaux" établie par la Swiss Funds et Asset Management Association SFAMA.

\*\* Dans le cas particulier de classes de parts lancées en cours d'exercice, les TER ont été calculés sur la base des Charges d'exploitation constatées depuis le lancement des classes de parts extrapolées sur une période de 12 mois. La fortune moyenne se calcule sur la base des valeurs de fin de mois de la période sous revue.

## **Comptes semestriels (Non audités par le Commissaire aux comptes)**

Le compte de résultat et l'état du patrimoine ci-dessous n'ont pas été audités par le Commissaire aux comptes de l'OPC.

## Bilan Actif

Bilan Actif au 30/12/2016

Portefeuille : 050829 AMUNDI RENDEMENT PLUS

|  | 30/12/2016              | 30/06/2016            |
|--|-------------------------|-----------------------|
| <b>IMMOBILISATIONS NETTES</b>  |                         |                       |
| <b>DÉPÔTS</b>  |                         |                       |
| <b>INSTRUMENTS FINANCIERS</b>  | <b>853 587 224,94</b>   | <b>709 828 646,72</b> |
| <b>Actions et valeurs assimilées</b>   | <b>124 651 503,59</b>   | <b>96 702 113,07</b>  |
| Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé  | 124 651 503,59          | 96 702 113,07         |
| Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé  |                         |                       |
| <b>Obligations et valeurs assimilées</b>   | <b>419 391 973,18</b>   | <b>445 750 668,41</b> |
| Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé  | 419 391 973,18          | 445 750 668,41        |
| Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé  |                         |                       |
| <b>Titres de créances</b>  |                         |                       |
| Négoiés sur un marché réglementé ou assimilé   |                         |                       |
| Titres de créances négociables   |                         |                       |
| Autres titres de créances  |                         |                       |
| Non négociés sur un marché réglementé ou assimilé  |                         |                       |
| <b>Organismes de placement collectif</b>   | <b>165 539 297,34</b>   | <b>79 160 281,30</b>  |
| OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays                                      | 149 931 572,95          | 69 224 081,30         |
| 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         | 5 354 224,39            |                       |
| Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés | 10 253 500,00           | 9 936 200,00          |
| Autres organismes non européens  |                         |                       |
| <b>Opérations temporaires sur titres</b>   | <b>139 847 749,11</b>   | <b>83 652 103,33</b>  |
| Créances représentatives de titres reçus en pension  |                         |                       |
| Créances représentatives de titres prêtés  | 139 847 749,11          | 83 652 103,33         |
| Titres empruntés   |                         |                       |
| Titres donnés en pension   |                         |                       |
| Autres opérations temporaires  |                         |                       |
| <b>Instruments financiers à terme</b>  | <b>4 156 701,72</b>     | <b>4 563 480,61</b>   |
| Opérations sur un marché réglementé ou assimilé  | 4 156 701,72            | 4 563 480,61          |
| Autres opérations  |                         |                       |
| Autres instruments financiers  |                         |                       |
| <b>CRÉANCES</b>  | <b>207 997 176,60</b>   | <b>193 897 163,55</b> |
| Opérations de change à terme de devises  | 192 879 958,61          | 185 033 611,41        |
| Autres   | 15 117 217,99           | 8 863 552,14          |
| <b>COMPTES FINANCIERS</b>  | <b>102 642 652,36</b>   | <b>83 624 818,34</b>  |
| Liquidités   | 102 642 652,36          | 83 624 818,34         |
| <b>TOTAL DE L'ACTIF</b>  | <b>1 164 227 053,90</b> | <b>987 350 628,61</b> |

## Bilan Passif

Bilan Passif au 30/12/2016

Portefeuille : 050829 AMUNDI RENDEMENT PLUS

|   | 30/12/2016              | 30/06/2016            |
|---|-------------------------|-----------------------|
| <b>CAPITAUX PROPRES</b>                                     |                         |                       |
| <b>Capital</b>  | 787 517 343,22          | 652 535 989,86        |
| Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées (a) |                         |                       |
| <b>Report à nouveau (a)</b>                                 | 5 678,49                |                       |
| Plus et moins-values nettes de l'exercice (a, b)            | <b>-449 160,52</b>      | <b>-10 758 433,60</b> |
| <b>Résultat de l'exercice (a, b)</b>                        | 2 752 859,16            | 7 576 028,14          |
| <b>TOTAL DES CAPITAUX PROPRES *</b>                         | <b>789 826 720,35</b>   | <b>649 353 584,40</b> |
| * Montant représentatif de l'actif net                      |                         |                       |
| <b>INSTRUMENTS FINANCIERS</b>                               | <b>151 531 761,45</b>   | <b>100 888 171,18</b> |
| Opérations de cession sur instruments financiers            |                         | <b>1 907,95</b>       |
| Opérations temporaires sur titres                           | <b>147 375 060,87</b>   | <b>96 725 231,70</b>  |
| Dettes représentatives de titres donnés en pension          |                         |                       |
| Dettes représentatives de titres empruntés                  | 0,18                    |                       |
| Autres opérations temporaires                               | 147 375 060,69          | 96 725 231,70         |
| Instruments financiers à terme                              | <b>4 156 700,58</b>     | <b>4 161 031,53</b>   |
| Opérations sur un marché réglementé ou assimilé             | 4 156 700,58            | 4 161 031,53          |
| Autres opérations   |                         |                       |
| <b>DETTES</b>   | <b>222 858 748,20</b>   | <b>237 108 873,03</b> |
| Opérations de change à terme de devises                     | 193 017 709,46          | 186 597 443,87        |
| Autres  | 29 841 038,74           | 50 511 429,16         |
| <b>COMPTES FINANCIERS</b>                                   | <b>9 823,90</b>         |                       |
| Concours bancaires courants                                 | 9 823,90                |                       |
| Emprunts  |                         |                       |
| <b>TOTAL DU PASSIF</b>                                      | <b>1 164 227 053,90</b> | <b>987 350 628,61</b> |

(a) Y compris comptes de régularisation

(b) Diminués des acomptes versés au titre de l'exercice



## Compte de Résultat

Compte de résultat au 30/12/2016

Portefeuille : 050829 AMUNDI RENDEMENT PLUS

|   | 30/12/2016          | 30/06/2016           |
|---|---------------------|----------------------|
| <b>Produits sur opérations financières</b>                      |                     |                      |
| Produits sur dépôts et sur comptes financiers                   | 50 733,49           | 17 838,99            |
| Produits sur actions et valeurs assimilées                      | 333 181,58          | 1 031 782,25         |
| Produits sur obligations et valeurs assimilées                  | 3 704 418,58        | 9 283 218,76         |
| Produits sur titres de créances                                 |                     | 12 466,98            |
| Produits sur acquisitions et cessions temporaires de titres     | 278 926,76          | 93 470,15            |
| Produits sur instruments financiers à terme                     |                     |                      |
| Autres produits financiers                                      |                     |                      |
| <b>Total (1)</b>  | <b>4 367 260,41</b> | <b>10 438 777,13</b> |
| <b>Charges sur opérations financières</b>                       |                     |                      |
| Charges sur acquisitions et cessions temporaires de titres      | 47 279,89           | 954,85               |
| Charges sur instruments financiers à terme                      |                     |                      |
| Charges sur dettes financières                                  | 34 747,68           | 40 001,52            |
| Autres charges financières                                      |                     |                      |
| <b>Total (2)</b>  | <b>82 027,57</b>    | <b>40 956,37</b>     |
| <b>Résultat sur opérations financières (1 - 2)</b>              | <b>4 285 232,84</b> | <b>10 397 820,76</b> |
| Autres produits (3)   |                     |                      |
| Frais de gestion et dotations aux amortissements (4)            | 1 868 199,16        | 3 629 665,24         |
| <b>Résultat net de l'exercice (L. 214-17-1) (1 - 2 + 3 - 4)</b> | <b>2 417 033,68</b> | <b>6 768 155,52</b>  |
| Régularisation des revenus de l'exercice (5)                    | 335 825,48          | 807 872,62           |
| Acomptes sur résultat versés au titre de l'exercice (6)         |                     |                      |
| <b>Résultat (1 - 2 + 3 - 4 + 5 + 6)</b>                         | <b>2 752 859,16</b> | <b>7 576 028,14</b>  |

## Etat du patrimoine en EUR

| Eléments de l'état du patrimoine                               | Montant à l'arrêté périodique * |
|--|---------------------------------|
| a) Titres financiers   | 544 043 476,77                  |
| b) Avoirs bancaires  | 102 642 652,36                  |
| c) Autres actifs détenus par l'OPC                             | 517 540 924,77                  |
| d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)           | 1 164 227 053,90                |
| e) Passif  | -374 400 333,55                 |
| f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC) | 789 826 720,35                  |

\* Les montants sont signés

## Distribution en cours de période

|                            | Part                       | Montant net unitaire<br>€ | Crédit d'impôt (1)<br>€ | Montant brut unitaire (2)<br>€ |
|----------------------------|----------------------------|---------------------------|-------------------------|--------------------------------|
| <b>Dividendes versés</b>   |                            |                           |                         |                                |
| 09/09/2016                 | AMUNDI RENDEMENT PLUS OR-D | 1,38                      | 0,00                    | 1,38                           |
| <b>Dividendes à verser</b> |                            |                           |                         |                                |
|                            | AMUNDI RENDEMENT PLUS OR-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.

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

### a) Titres et matières premières prêtés

|                   |                |  |  |  |  |
|-------------------|----------------|--|--|--|--|
| Montant           | 139 794 977,02 |  |  |  |  |
| % de l'actif net* | 19,77%         |  |  |  |  |

\*% 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          | 139 794 977,02 |  |  |  |  |
| % de l'actif net | 17,70%         |  |  |  |  |

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

|   |               |  |  |  |  |
|---|---------------|--|--|--|--|
| AMUNDI ETF GLOBAL EQUITY MULTI SMART ALL FRANCE                           | 31 043 169,19 |  |  |  |  |
| AMUNDI ETF JPX-NIKKEI 400 UCITS ETF FRANCE                                | 17 067 948,11 |  |  |  |  |
| ENEL – ENTE NAZIONALE PER L'ENERGIA ELETTRICA ITALIE                      | 11 360 523,76 |  |  |  |  |
| NATIONAL GRID PLC ROYAUME UNI   | 8 004 721,86  |  |  |  |  |
| AMUNDI ETF CAC40 FRANCE   | 6 700 803,61  |  |  |  |  |
| VODAFONE GROUP PLC ROYAUME UNI  | 6 369 708,47  |  |  |  |  |
| AMUNDI ETF MSCI WORLD FINANCIALS FCP (AMUNDI INVESTMENT SOLUTIONS) FRANCE | 5 539 235,63  |  |  |  |  |
| AMUNDI ETF MSCI WORLD LOW CARBON UCITS ETF FRANCE                         | 5 282 238,64  |  |  |  |  |
| SHIRE PLC / EX SHIRE LTD JERSEY   | 5 158 106,84  |  |  |  |  |
| AMUNDI EM EU EX EMU (AMUNDI) FRANCE                                       | 4 836 462,00  |  |  |  |  |

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

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

|   |               |  |  |  |  |
|---|---------------|--|--|--|--|
| BNP ARBITRAGE PARIS<br>FRANCE                           | 72 591 217,74 |  |  |  |  |
| BNP PARIBAS SECURITIES<br>FRANCE                        | 18 657 106,94 |  |  |  |  |
| BANK OF NOVA SCOTIA –<br>TORONTO (TM)<br>CANADA         | 16 516 163,91 |  |  |  |  |
| JP MORGAN SECURITIES<br>LONDRES<br>ROYAUME UNI          | 13 282 014,40 |  |  |  |  |
| MERRIL LYNCH<br>INTERNATIONAL LIMITED<br>ROYAUME UNI    | 7 234 929,47  |  |  |  |  |
| SKANDINAVIA ENSKILDA<br>BANK<br>SUEDE                   | 4 639 521,14  |  |  |  |  |
| NATIXIS<br>FRANCE                                       | 2 143 250,18  |  |  |  |  |
| CREDIT SUISSE SECURITIES<br>(EUROPE) – LONDON<br>SUISSE | 1 707 796,39  |  |  |  |  |
| CREDIT AGRICOLE CIB<br>FRANCE                           | 1 702 820,00  |  |  |  |  |
| SOCIETE GENERALE<br>FRANCE                              | 1 226 916,65  |  |  |  |  |

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

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

| Type          |               |  |  |  |  |
|---------------|---------------|--|--|--|--|
| - Actions     | 47 741 866,54 |  |  |  |  |
| - Obligations | 9 940 424,01  |  |  |  |  |
| - OPC         | 89 692 770,14 |  |  |  |  |
| - TCN         |               |  |  |  |  |
| - Cash        | 19 830 813,67 |  |  |  |  |
| <b>Rating</b> |               |  |  |  |  |

| Monnaie de la garantie |                |  |  |  |  |
|------------------------|----------------|--|--|--|--|
| - FRANC SUISSE         | 3 578 895,90   |  |  |  |  |
| - EURO                 | 128 897 232,84 |  |  |  |  |
| - DOLLAR US            | 6 159 632,81   |  |  |  |  |
| - YEN                  | 490 897,29     |  |  |  |  |
| - LIVRE STERLING       | 27 946 280,21  |  |  |  |  |
| - DOLLAR DE HONG-KONG  | 132 935,31     |  |  |  |  |

### f) Règlement et compensation des contrats

|                       |   |  |  |   |  |
|-----------------------|---|--|--|---|--|
| Triparties            |   |  |  | X |  |
| Contrepartie centrale |   |  |  |   |  |
| Bilatéraux            | X |  |  | X |  |

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

|                      |                |  |  |  |  |
|----------------------|----------------|--|--|--|--|
| < 1 jour             |                |  |  |  |  |
| [1 jour - 1 semaine] |                |  |  |  |  |
| ]1 semaine - 1 mois] |                |  |  |  |  |
| ]1 mois - 3 mois]    |                |  |  |  |  |
| ]3 mois - 1 an]      | 8 965 591,03   |  |  |  |  |
| > 1 an               | 974 832,98     |  |  |  |  |
| Ouvertes             | 137 434 636,68 |  |  |  |  |

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

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

|                      |                |  |  |  |  |
|----------------------|----------------|--|--|--|--|
| < 1 jour             |                |  |  |  |  |
| [1 jour - 1 semaine] |                |  |  |  |  |
| ]1 semaine - 1 mois] |                |  |  |  |  |
| ]1 mois - 3 mois]    |                |  |  |  |  |
| ]3 mois - 1 an]      |                |  |  |  |  |
| > 1 an               |                |  |  |  |  |
| Ouvertes             | 139 794 977,02 |  |  |  |  |

### 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             | 147 375 060,69 |  |  |  |  |
| Cash               | 19 830 813,67  |  |  |  |  |

### 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          | 277 241,02 | 843,86 |  | 841,88 |  |
| - Gestionnaire |            |        |  |        |  |
| - Tiers        |            |        |  |        |  |
| <b>Coûts</b>   |            |        |  |        |  |
| - OPC          | 47 279,89  |        |  |        |  |
| - Gestionnaire |            |        |  |        |  |
| - Tiers        |            |        |  |        |  |

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

Amundi 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.

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

### **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 les revenus et les coûts ventilés**

Amundi 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**

Dans le cadre des opérations de prêts de titres et de mise en pension, Amundi Asset Management, a confié à Amundi Intermédiation, pour le compte de l'OPCVM, 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 résultant de ces opérations sont restitués à l'OPCVM. Ces opérations engendrent des coûts qui sont supportés par l'OPCVM. La facturation par Amundi Intermédiation ne peut excéder 50% des revenus générés par ces opérations.



**Amundi Asset Management**

Société Anonyme au capital de 746 262 615 euros

Société de Gestion de Portefeuille agréée par l'AMF sous le n° GP 04000036

Siège social : 90, boulevard Pasteur 75015 Paris - France - 437 574 452 RCS Paris