



Investment
Managers

Document d'Information
Périodique Semestriel
au 30/06/2020

AXA IM Euro Liquidity

Forme juridique : FCP
 Classification : Monétaire
 Affectation des résultats : Capitalisation

Etat du patrimoine

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Les titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 (OPCVM) / 1° du I de l'article L.214-24-55 (FIVG)* du code monétaire et financier	3 549 865 343,34
b) Avoirs bancaires	390 223 572,91
c) Autres actifs détenus par l'OPC	314 663 736,08
d) Total des actifs détenus par l'OPC	4 254 752 652,33
e) Passif	-53 946 828,79
f) Valeur nette d'inventaire	4 200 805 823,54

*Les montants sont signés.

Nombre de parts en circulation et valeur nette d'inventaire par part ou action

Part	Type de part	Actif net par type de part	Nombre de part en circulation	Valeur Liquidative
AXA IM Euro Liquidity	C	4 200 805 823,54	94 160,87	44 613,07

Les chiffres cités ont trait aux années ou aux mois écoulés et les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures.

Eléments du portefeuille titres

Eléments du portefeuille titres :	Pourcentage de l'Actif net*	Pourcentage du Total des actifs**
a) les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier	64,73	63,91
b) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen	0,00	0,00
c) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières	19,77	19,52
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier ; (Article R. 214-11-I- 4° (OPCVM) / Article R.214-32-18-I-4° (FIVG) du code monétaire et financier)	0,00	0,00
e) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-11 et à l'article R.214-32-19 du Code monétaire et financier	0,00	0,00

*f) de l'état du patrimoine

**d) de l'état du patrimoine

Répartition des actifs du a), b), c), d) du portefeuille titres, par devise

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage de l'Actif net*	
Titres	Devise	0,00	0,00	0,00
BUONI POLIE 3.25% 46	EUR	149 999 999,98	3,51	3,51
CSE D AMORT DETTE 4.	EUR	100 000 756,00	2,38	2,35
ECP RECKITT 12/08/20	EUR	59 996 602,26	1,43	1,41
HSBC BANK PLC 2021	EUR	50 190 016,67	1,19	1,18
ECP BANC SANT 28/21	EUR	50 068 475,80	1,19	1,18
ECP SANTAND 25/01/21	EUR	50 043 589,37	1,19	1,18
ECP KONINKL 02/09/20	EUR	50 013 853,68	1,19	1,18
ECP INTESA 15/02/21	EUR	49 997 521,48	1,19	1,18
SOCIETE GEN 21	EUR	49 876 368,73	1,19	1,17
ECP APRR SA 31/07/20	EUR	49 011 415,44	1,17	1,15
ECP SNAM 30/07/2020	EUR	47 005 744,23	1,12	1,10
ECP ENEL FI 31/08/20	EUR	45 001 461,10	1,07	1,06
ECP AMADEUS 30/11/20	EUR	44 978 976,83	1,07	1,06
ECP ELECTR 22/06/21	EUR	43 072 425,92	1,03	1,01
ECP DXC CAP 13/07/20	EUR	41 997 387,56	1,00	0,99
ECP LEGRAND 31/07/20	EUR	41 007 227,41	0,98	0,96
SOCGEN 14/01/21	EUR	40 860 937,07	0,97	0,96
ECP IBERDRO 24/02/21	EUR	40 053 104,29	0,95	0,94
ECP KERING 17/09/20	EUR	40 014 981,89	0,95	0,94
ECP IBERDRO 09/07/20	EUR	40 003 645,92	0,95	0,94
ECP CONTINE 31/08/20	EUR	39 993 593,40	0,95	0,94
ECP BPCE 25/06/21	EUR	39 989 550,09	0,95	0,94
ECP HSBC 10/11/20	EUR	39 932 047,02	0,95	0,94
ABNANV 15/01/21	EUR	38 532 238,23	0,92	0,91
ECP SNAM 03/08/20	EUR	38 005 699,14	0,90	0,89
ECP APRR SA 18/06/21	EUR	37 996 293,38	0,90	0,89
TOYOTA 2021	EUR	35 154 985,83	0,84	0,83
ECP UBS AG 23/06/21	EUR	35 076 627,19	0,84	0,82
BNS 18/01/2021	EUR	35 053 266,11	0,83	0,82
ECP ENI FIN 15/03/21	EUR	35 038 095,27	0,83	0,82
ECP BARCL 01/02/21	EUR	35 006 559,66	0,83	0,82
ECP EON 02/07/20	EUR	34 999 965,68	0,83	0,82
ECP DH EURO 28/07/20	EUR	34 998 455,98	0,83	0,82
ECP KLEPIER 04/03/21	EUR	34 043 789,20	0,81	0,80
ABB FINANCE 20	EUR	33 603 238,21	0,80	0,79
GLAX 23/09/2021	EUR	33 396 316,03	0,80	0,78
INTNED 2021	EUR	32 876 722,84	0,78	0,77
ECP ENAGAS 31/07/20	EUR	31 005 294,07	0,74	0,73
JPM MORG 18/06/2021	EUR	30 154 721,67	0,72	0,71
RY 25/01/2021	EUR	30 123 876,40	0,72	0,71
ECP SUEZ 04/06/21	EUR	30 041 735,98	0,72	0,71
ECP VEOLIA 27/11/20	EUR	30 037 893,80	0,72	0,71
ECP UBS AG 06/11/20	EUR	30 033 787,34	0,71	0,71
ECP VEOLIA 15/10/20	EUR	30 028 952,66	0,71	0,71
ECP ENI 16/06/21	EUR	30 027 884,55	0,71	0,71
ECP SANTAND 24/11/20	EUR	30 025 730,22	0,71	0,71
ECP BANCO 18/08/20	EUR	30 016 002,08	0,71	0,71
ECP INTESA 22/09/20	EUR	30 012 220,48	0,71	0,71

ECP FIDELIT 06/07/20	EUR	29 999 662,09	0,71	0,71
ECP FIDELIT 06/07/20	EUR	29 999 662,09	0,71	0,71
ECP FIDELIT 13/07/20	EUR	29 998 689,91	0,71	0,71
ECP FIDELIT 31/07/20	EUR	29 994 873,30	0,71	0,70
ECP VATTENF 02/10/20	EUR	29 984 680,39	0,71	0,70
ECP CONTINE 26/11/20	EUR	29 981 449,81	0,71	0,70
ECP A.B INB 05/01/21	EUR	29 971 712,99	0,71	0,70
ECP VATTEN 17/06/21	EUR	29 886 928,78	0,71	0,70
ECP APRR SA 30/09/20	EUR	29 515 779,87	0,70	0,69
ECP SNAM 16/07/20	EUR	28 501 781,70	0,68	0,67
ECP RECKITT 10/07/20	EUR	28 499 546,45	0,68	0,67
ECP CAIXA 07/01/21	EUR	28 037 694,44	0,67	0,66
ECP BANCO 03/07/20	EUR	28 000 643,08	0,67	0,66
ECP A.B INB 24/09/20	EUR	26 990 366,50	0,64	0,63
BMW 15/01/21	EUR	26 015 556,67	0,62	0,61
BMO 22/03/2021	EUR	25 692 025,86	0,61	0,60
TORONTO DOMINION BAN	EUR	25 172 407,53	0,60	0,59
ECP BANCO 17/06/21	EUR	25 066 860,84	0,60	0,59
ECP BPCE 01/06/21	EUR	25 056 754,65	0,60	0,59
BANK OF 0.282% 21	EUR	25 047 843,06	0,60	0,59
ECP ELECTR 24/03/21	EUR	25 039 426,39	0,60	0,59
ECP CAIXA 08/01/21	EUR	25 033 890,19	0,60	0,59
ECP IBERDRO 21/12/20	EUR	25 030 131,06	0,60	0,59
ECP ENGIE 14/08/20	EUR	25 009 125,74	0,60	0,59
ECP WOLTERS 17/07/20	EUR	25 001 210,53	0,60	0,59
ECP E. ON 06/07/20	EUR	24 999 875,70	0,60	0,59
ECP A.B INB 28/01/21	EUR	24 972 606,20	0,59	0,59
TOYOTA 21	EUR	24 491 639,73	0,58	0,58
ECP KLEPIER 23/10/20	EUR	23 514 271,11	0,56	0,55
ECP SNAM 02/09/2020	EUR	23 004 021,03	0,55	0,54
ECP APRR SA 25/06/21	EUR	22 997 706,62	0,55	0,54
ECP UBS AG 15/06/21	EUR	20 042 914,48	0,48	0,47
ECP ENGIE 07/06/21	EUR	20 037 966,65	0,48	0,47
ECP BANCO 16/12/20	EUR	20 033 509,83	0,48	0,47
ECP BANC 14/06/21	EUR	20 033 116,23	0,48	0,47
ECP SUEZ 10/05/21	EUR	20 028 395,74	0,48	0,47
ECP BPCE 01/12/20	EUR	20 028 151,90	0,48	0,47
ECP ENI 14/12/20	EUR	20 019 696,53	0,48	0,47
ECP ENGIE 04/12/20	EUR	20 018 306,30	0,48	0,47
ECP VEOLIA 24/09/20	EUR	20 015 218,65	0,48	0,47
ECP LINDE A 05/10/20	EUR	20 011 960,04	0,48	0,47
ECP RED EL 01/10/20	EUR	20 010 312,55	0,48	0,47
CD INTESA 23/10/20	EUR	20 009 229,18	0,48	0,47
ECP LINDE A 14/07/20	EUR	20 002 079,49	0,48	0,47
ECP INTESA 08/07/20	EUR	20 001 023,66	0,48	0,47
ECP VATTENF 10/07/20	EUR	20 000 844,75	0,48	0,47
ECP LINDE A 06/07/20	EUR	20 000 815,03	0,48	0,47
ECP EDENRED 06/07/20	EUR	20 000 373,90	0,48	0,47
ECP VATTENF 07/08/20	EUR	20 000 124,86	0,48	0,47
ECP DH EURO 24/07/20	EUR	19 999 102,19	0,48	0,47
ECP ECOLAB 11/09/20	EUR	19 996 550,01	0,48	0,47
ECP VATTENF 21/09/20	EUR	19 993 348,75	0,48	0,47
ECP DXC CAP 29/07/20	EUR	18 997 328,39	0,45	0,45

ECP HONEYWE 13/07/20	EUR	18 000 829,75	0,43	0,42
ECP CONTINE 30/11/20	EUR	17 987 476,32	0,43	0,42
ECP A.B INB 28/08/20	EUR	16 998 085,91	0,40	0,40
FIS 21/05/2021	EUR	16 545 239,42	0,39	0,39
ECP SUEZ 26/10/20	EUR	16 011 080,90	0,38	0,38
ECP CONTINE 27/11/20	EUR	15 989 259,35	0,38	0,38
ECP IBERDRO 02/11/20	EUR	15 014 708,41	0,36	0,35
ECP DH EURO 10/08/20	EUR	14 998 919,49	0,36	0,35
BANK OF NOVA SCOTIA	EUR	14 211 061,80	0,34	0,33
MDT 07/03/2021	EUR	13 316 017,09	0,32	0,31
ECP A.B INB 24/08/20	EUR	12 998 764,19	0,31	0,31
ECP VEOLIA 21/07/20	EUR	11 602 386,87	0,28	0,27
ECP A.B INB 05/11/20	EUR	10 994 379,95	0,26	0,26
ECP SUEZ 14/12/20	EUR	10 008 277,64	0,24	0,24
ECP LINDE A 15/07/20	EUR	10 001 034,22	0,24	0,24
ECP LEGRAND 31/07/20	EUR	9 001 571,50	0,21	0,21
ECP DXC CAP 24/07/20	EUR	8 998 891,15	0,21	0,21
ECP DXC CAP 23/07/20	EUR	6 999 163,89	0,17	0,16
ECP A.B INB 02/09/20	EUR	6 999 106,89	0,17	0,16
ECP DH EURO 23/07/20	EUR	4 999 861,04	0,12	0,12
TOTAL	EUR	3 549 865 343,34	84,50	83,43
TOTAL		3 549 865 343,34	84,50	83,43
AUTRES ACTIFS DETENUS (b+c de l'état du patrimoine)		704 887 308,99		16,57
TOTAL DES ACTIFS		4 254 752 652,33		100,00
AUTRES ACTIFS DETENUS (b+c+e de l'état du patrimoine)		650 940 480,20	15,50	
TOTAL ACTIF NET		4 200 805 823,54	100,00	

*f) de l'état du patrimoine

**d) de l'état du patrimoine

Répartition des actifs du a), b), c), d) du portefeuille titres, par secteur économique

Secteur économique	Pourcentage de l'Actif net*	Pourcentage du Total des actifs**
Banque commerciale - non US	23,20	22,93
Electricité - intégré	6,86	6,78
banque - Clientèle diverse	5,36	5,29
Electricité - Distribution	3,69	3,64
Souverain	3,57	3,53
Autres secteurs économiques	41,82	41,26
TOTAL	84,50	83,43
AUTRES ACTIFS DETENUS (b+c de l'état du patrimoine)		16,57
TOTAL DES ACTIFS		100,00
AUTRES ACTIFS DETENUS (b+c+e de l'état du patrimoine)	15,50	
TOTAL ACTIF NET	100,00	

*f) de l'état du patrimoine

**d) de l'état du patrimoine

Répartition des actifs du a), b), c), d) du portefeuille titres, par pays de résidence de l'émetteur

	Pourcentage de l'Actif net*	Pourcentage du Total des actifs**
Pays	0,00	0,00
		0,00
FRANCE	21,99	21,70
PAYS-BAS	10,74	10,61
Italie	8,96	8,85
Autres pays	42,81	42,27
TOTAL	84,50	83,43
AUTRES ACTIFS DETENUS (b+c de l' état du patrimoine)		16,57
TOTAL DES ACTIFS		100,00
AUTRES ACTIFS DETENUS (b+c+e de l' état du patrimoine)	15,50	
TOTAL ACTIF NET	100,00	

*f) de l'état du patrimoine

**d) de l'état du patrimoine

Ventilation des autres actifs par nature*

Nature d'actifs	Pourcentage de l'Actif net**	Pourcentage du Total des actifs***
PARTS D'OPC	1,95	1,92
Fonds d' investissement à vocation générale	0,00	0,00
FCPR, FCPI, FIP	0,00	0,00
OPCI, SCPI, SEF, SICAF, Fonds de Fonds alternatifs	0,00	0,00
OPCVM	1,95	1,92
Fonds professionnels à vocation générale	0,00	0,00
OPCI, fonds spécialisés, fonds de capital investissement (professionnels)	0,00	0,00
Organisme de Titrisation	0,00	0,00
Autres placements collectifs	0,00	0,00
AUTRES NATURE D'ACTIFS	0,00	0,00
Bons de souscriptions	0,00	0,00
Bons de caisse	0,00	0,00
Billet à ordre	0,00	0,00
Billets hypothécaires	0,00	0,00
Autres	0,00	0,00
TOTAL	1,95	1,92

* Cette rubrique concerne des titres financiers éligibles ou des instruments du marché monétaire ne répondant pas aux conditions mentionnées au I de l'article R.214-11 du Code monétaire et financier

**f) de l'état du patrimoine

***d) de l'état du patrimoine

Mouvements dans le portefeuille titres en cours de période

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant) Acquisitions	Mouvements (en montant) Cessions
a) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier	6 707 220 400,00	6 096 922 281,98
b) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen	0,00	0,00
c) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'OPCVM / du fonds d'investissement à vocation générale	0,00	30 012 600,00
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier ; (Article R.214-11-I- 4° (OPCVM) / Article R.214-32-18-I-4° (FIVG) du code monétaire et financier)	0,00	0,00
e) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-11 et à l'article R.214-32-19 du Code monétaire et financier	0,00	0,00

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	6 707 220 400,00
Cessions	6 126 934 881,98

Distribution en cours de période

	Part	Montant net unitaire	Crédit d'impôt	Montant brut unitaire
Dividendes versés				
Dividendes à verser				

Modifications intervenues

Mise à jour annuelle du KID. // Mise à jour de la stratégie/politique d'investissement du prospectus et du Document d'Informations Clés pour l'Investisseur (DICI) conformément aux dispositions de l'ESMA (Guidelines). // Mise à jour du DICI (partie "Frais prélevés par le fonds dans certaines circonstances").

Modifications à intervenir

Remplacement des références de SSB Paris par celle de SSB International GmbH, Paris Branch, en tant qu'entité délégitaire de la gestion comptable (Projet de succursalisation de SSB Paris).

Le prospectus complet (visé par l'AMF) est disponible sur simple demande auprès d'AXA Investment Managers Paris - Tour Majunga - La Défense 9 - 6, Place de la Pyramide - 92800 Puteaux

Le détail du portefeuille peut-être demandé dans un délai de huit semaines auprès d'AXA Investment Managers Paris

Commissaire aux comptes :

PriceWaterhouseCoopers France

Glossaire

Informations sur le contenu du tableau relatif à l'état du patrimoine	
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du Code monétaire et financier	Les titres de capital émis par les sociétés par actions ; Les titres de créance, à l'exclusion des effets de commerce et des bons de caisse ;
b) Avoirs bancaires	Les avoirs bancaires correspondent aux «liquidités» du poste «comptes financiers» ausens du § 420-1 du règlement CRC n°2003-02.
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	Les autres actifs comprennent les instruments financiers exclus du a) : <ul style="list-style-type: none"> ■ les instruments financiers du marché monétaire, ■ les bons de souscription, ■ les effets de commerce, billets à ordre et billets hypothécaires. ■ Ainsi que les éléments suivants au sens du § 420-1 du règlement CRC n°2003-02 : <ul style="list-style-type: none"> ■ les dépôts, ■ les parts ou actions d'OPC, ■ les opérations temporaires sur titres. ■ les instruments financiers à terme, ■ les autres instruments financiers, ■ les créances (y.c. les opérations de change à terme).
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	Total des lignes (a+b+c)
e) Passif	Le passif comprend les éléments suivants au sens du § 420-2 du règlement CRC n°2003-02 : <ul style="list-style-type: none"> ■ les instruments financiers au passif du bilan (opérations de cession sur instruments financiers et opérations temporaires de titres), ■ les instruments financiers à terme au passif du bilan, ■ les dettes (y.c. les opérations de change à terme de devises), ■ les comptes financiers (concours bancaires courants et emprunts).
f) Valeur nette d'inventaire	Total des lignes (d+e) La valeur nette d'inventaire correspondant au montant de l'actif net de l'OPCVM.

Informations sur le contenu du tableau relatif aux éléments du portefeuille titres

Article L. 422-1 du Code monétaire et financier	I. Tout marché réglementé d'un Etat membre de la Communauté européenne ou d'un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen qui fonctionne sans requérir la présence effective de personnes physiques peut offrir, sur le territoire de la France métropolitaine et des départements d'outre-mer et de Saint-Barthélemy et de Saint-Martin, les moyens d'accès à ce marché. II. Lorsque l'Autorité des marchés financiers a des raisons claires et démontrables d'estimer qu'un marché réglementé d'un autre Etat membre de la Communauté européenne ou d'un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen qui offre des moyens d'accès sur le territoire de la France métropolitaine et des départements d'outre-mer et de Saint-Barthélemy et de Saint-Martin enfreint les obligations qui lui incombent, elle en fait part à l'autorité compétente de l'Etat d'origine dudit marché réglementé. Si, en dépit des mesures prises par l'autorité compétente de l'Etat d'origine ou en raison du caractère inadéquat de ces mesures, le marché réglementé continue de fonctionner d'une manière clairement préjudiciable aux intérêts des investisseurs ou au fonctionnement ordonné des marchés en France, l'Autorité des marchés financiers, après en avoir informé l'autorité compétente de l'Etat d'origine, prend toutes les mesures appropriées requises pour protéger les investisseurs ou pour préserver le bon fonctionnement des marchés. Elle peut notamment interdire à ce marché réglementé de mettre ses moyens d'accès à la disposition de membres à distance établis sur le territoire de la France métropolitaine et des départements d'outre-mer et de Saint-Barthélemy et de Saint-Martin. L'Autorité des marchés financiers notifie sa décision, dûment motivée, au marché réglementé concerné. Elle en informe sans délai la Commission européenne.
---	---

<p>4° du I de l'article R. 214-11 du Code monétaire et financier</p>	<p>(...) titres financiers éligibles nouvellement émis sous réserve que : a) Les conditions d'émission comportent l'engagement qu'une demande d'admission à la cotation officielle d'une bourse de valeurs ou à un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, sera introduite, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières ; b) L'admission mentionnée au a soit obtenue dans un délai d'un an à compter de l'émission.</p>
<p>II de l'article R. 214-11 du Code monétaire et financier</p>	<p>Un organisme de placement collectif en valeurs mobilières ne peut employer plus de 10 % de ses actifs dans des titres financiers éligibles ou des instruments du marché monétaire ne répondant pas aux conditions mentionnées au I. Il ne peut acquérir des certificats représentatifs de métaux précieux.</p>
<p>Article R. 214-32-19 du Code monétaire et financier</p>	<p>I. - L'actif d'un fonds d'investissement à vocation générale peut également comprendre, dans la limite de 10 % prévue au II de l'article R. 214-32-18 : 1° Des bons de souscription ; 2° Des bons de caisse ; 3° Des billets à ordre ; 4° Des billets hypothécaires ; 5° Des actions ou parts de FIA établis dans un autre Etat membre de l'Union européenne ou de fonds d'investissement de droit étranger répondant aux critères fixés par le règlement général de l'Autorité des marchés financiers ; 6° Des actions ou parts de FIA ou organismes de placement collectifs en valeurs mobilières suivants : a) Organismes de placement collectifs nourriciers mentionnés aux articles L. 214-22 et L. 214-24-57 ; b) OPCVM bénéficiant d'une procédure allégée mentionnés à l'article L. 214-35 dans sa rédaction antérieure au 2 août 2003 ; c) OPCVM et FIA relevant des paragraphes 1,2 et 6 de la sous-section 2, du paragraphe 2 ou du sous-paragraphe 1 du paragraphe 1 de la sous-section 3 de la présente section qui investissent plus de 10 % de leurs actifs en actions ou parts de placements collectifs ou de fonds d'investissement ; d) Fonds professionnels à vocation générale mentionnés à l'article L. 214-144 ; e) Fonds professionnels spécialisés mentionnés à l'article L. 214-154 ; f) Fonds communs de placement à risques mentionnés à l'article L. 214-28, fonds communs de placement dans l'innovation mentionnés à l'article L. 214-30, fonds d'investissement de proximité mentionnés à l'article L. 214-31 et fonds professionnels de capital investissement mentionnés à l'article L. 214-160 ; g) Fonds communs d'intervention sur les marchés à terme mentionnés à l'article L. 214-42 dans sa rédaction antérieure à la date de publication de l'ordonnance n° 2011-915 du 1er août 2011 ; 7° Des titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire ne répondant pas aux conditions mentionnées au I de l'article R. 214-32-18 ; 8° Des parts ou actions d'organismes de placement collectif immobilier, d'organismes professionnels de placement collectif immobilier ou d'organismes étrangers mentionnées au 5° du I de l'article L. 214-36. En outre, sont incluses dans la limite de 10 % mentionnée au premier alinéa les parts ou actions d'OPCVM, de FIA relevant des paragraphes 1,2 et 6 de la sous-section 2 du paragraphe 2 ou du sous-paragraphe 1 du paragraphe 1 de la sous-section 3 de la présente section, de FIA relevant d'un autre Etat membre de l'Union européenne ou de fonds d'investissement étrangers eux-mêmes investis à plus de 10 % en parts ou actions d'OPCVM, de FIA relevant des paragraphes 1,2 et 6 de la sous-section 2, du paragraphe 2 ou du sous-paragraphe 1 du paragraphe 1 de la sous-section 3 de la présente section, de FIA relevant d'un autre Etat membre de l'Union européenne ou de fonds d'investissement étrangers. Pour l'application du présent paragraphe, les actions de sociétés de placement à prépondérance immobilière à capital variable mentionnées à l'article L. 214-62 relèvent du seul 8°. II. - L'actif d'un fonds d'investissement à vocation générale peut également comprendre, dans la limite de 10 % prévue au I, des créances, si ces dernières satisfont aux règles suivantes : 1° La propriété de la créance est fondée, soit sur une inscription, soit un acte authentique, soit sur un acte sous seing privé dont la valeur probante est reconnue par la loi française ; 2° La créance ne fait l'objet d'aucune sûreté autre que celles éventuellement constituées pour la réalisation de l'objectif de gestion du fonds d'investissement à vocation générale ; 3° La créance fait l'objet d'une valorisation fiable sous forme d'un prix calculé de façon précise et établi régulièrement, qui est soit un prix de marché, soit un prix fourni par un système de valorisation permettant de déterminer la valeur à laquelle l'actif pourrait être échangé entre des parties avisées et contractant en connaissance de cause dans le cadre d'une transaction effectuée dans des conditions normales de concurrence ; 4° La liquidité de la créance permet au fonds d'investissement à vocation générale de respecter ses obligations en matière d'exécution des rachats vis-à-vis de ses porteurs et actionnaires, telles que définies par ses statuts ou son règlement</p>

Actifs engagés pour chaque type d'opérations de financement sur titres et Total Return Swaps exprimés en valeur absolue et en pourcentage de l'actif net du fonds

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
Montant				250 000 755,98	
% de l'actif net total				5,95	

Un tableau vide signifie qu'aucune donnée n'est à reporter.

Montant des titres et matières premières prêtés en proportion des actifs

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
Montant des actifs prêtés					
% des actifs pouvant être prêtés					

Un tableau vide signifie qu'aucune donnée n'est à reporter.

10 principaux émetteurs de garanties reçues (hors liquidités) pour tous les types d'opérations de financement (volume de garanties au titre des transactions en cours)

1.Nom	
Volume des garanties reçues	
2.Nom	
Volume des garanties reçues	
3.Nom	
Volume des garanties reçues	
4.Nom	
Volume des garanties reçues	
5.Nom	
Volume des garanties reçues	
6.Nom	
Volume des garanties reçues	
7.Nom	
Volume des garanties reçues	
8.Nom	
Volume des garanties reçues	
9.Nom	
Volume des garanties reçues	
10.Nom	
Volume des garanties reçues	

Un tableau vide signifie qu'aucune donnée n'est à reporter.

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

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
1.Nom				BNP PARIBAS PA	
Montant				149 952 962,48	
Domicile				FRANCE	
2.Nom				BANQUE POSTALE	
Montant				99 971 819,67	
Domicile				FRANCE	
3.Nom					
Montant					
Domicile					
4.Nom					
Montant					
Domicile					
5.Nom					
Montant					
Domicile					
6.Nom					
Montant					
Domicile					
7.Nom					
Montant					
Domicile					
8.Nom					
Montant					
Domicile					
9.Nom					
Montant					
Domicile					
10.Nom					
Montant					
Domicile					

Un tableau vide signifie qu'aucune donnée n'est à reporter.

Type et qualité des garanties (collatéral), en valeur absolue et sans compensation

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
Type et qualité de la garantie					
Liquidités					
Instruments de dette					
Notation de bonne qualité					
Notation de moyenne qualité					
Notation de faible qualité					
Actions					
Notation de bonne qualité					
Notation de moyenne qualité					
Notation de faible qualité					
Parts de fonds					
Notation de bonne qualité					
Notation de moyenne qualité					
Notation de faible qualité					
Monnaie de la garantie					
Pays de l'émetteur de la garantie					

Un tableau vide signifie qu'aucune donnée n'est à reporter.

Échéance de la garantie, ventilée en fonction des tranches ci-dessous

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
moins d'1 jour					
1 jour à 1 semaine					
1 semaine à 1 mois					
1 à 3 mois					
3 mois à 1 an					
plus d'1 an					
ouvertes					

Un tableau vide signifie qu'aucune donnée n'est à reporter.

Échéance de la garantie, en valeur absolue et sans compensation, ventilée en fonction des tranches ci-dessous

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
moins d'1 jour					
1 jour à 1 semaine					
1 semaine à 1 mois				149 952 962,48	
1 à 3 mois				99 971 819,67	
3 mois à 1 an					
plus d'1 an					
ouvertes					

Un tableau vide signifie qu'aucune donnée n'est à reporter.

Règlement et compensation des contrats

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
Contrepartie centrale					
Bilatéraux				249 924 782,15	
Trois parties					

Un tableau vide signifie qu'aucune donnée n'est à reporter.

La compensation des contrats financiers listés détenus par le portefeuille est réalisé par le biais d'une contrepartie centrale

La compensation des contrats financiers non listés détenus par le portefeuille et éligibles à la compensation centrale selon EMIR est réalisé par le biais d'une contrepartie centrale

La compensation des contrats financiers non listés détenus par le portefeuille et non éligibles à la compensation centrale selon EMIR est réalisé de manière bilatérale avec les contreparties des transactions

La compensation des opérations efficaces de portefeuilles est réalisée par un tiers aux transactions dans le cadre d'un contrat tri-partite de collatéral management.

Données sur la réutilisation des garanties

	Espèces	Titres
Montant maximal (%)	100,00	0,00
Montant utilisé (%)		
Revenus pour l'OPC suite au réinvestissement des garanties espèces des opérations de financement sur titres et TRS		

Un tableau vide signifie qu'aucune donnée n'est à reporter.

Données sur la conservation des garanties reçues par l'OPC

1.Nom	
Montant conservé	

Un tableau vide signifie qu'aucune donnée n'est à reporter.

Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC

Montant total du collatéral versé	
En % de toutes les garanties versées	
Comptes séparés	
Comptes groupés	
Autres comptes	

Un tableau vide signifie qu'aucune donnée n'est à reporter.

Données sur les revenus ventilées

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
OPC					
Montant					
en % du revenus					
Gestionnaire					
Montant					
en % du revenus					
Tiers (ex. agent prêteur...)					
Montant					
en % du revenus					

Un tableau vide signifie qu'aucune donnée n'est à reporter.

Données sur les coûts ventilées

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mises en pension	Prises en pension	Total Return Swap
OPC					
Montant					
Gestionnaire					
Montant					
Tiers (ex. agent prêteur...)					
Montant					

Un tableau vide signifie qu'aucune donnée n'est à reporter.