

ALLIANZ EURO OBLIG COURT TERME ISR

Document d'information périodique

28.06.2024

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

État du patrimoine

Éléments de l'état du patrimoine	Devise de comptabilité de l'OPC : EUR	Montant à l'arrêté périodique
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L.214-20 / 1° du I de l'article L.214-24-55 du code monétaire et financier		698 532 672,09
b) Avoirs bancaires		56 854 014,08
c) Autres actifs détenus par l'OPC		75 070 145,04
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)		830 456 831,21
e) Passif		-23 670 729,36
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net OPC)		806 786 101,85

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

Parts ou actions	Nombre de parts ou actions en circulation	Devise parts ou actions	Valeur nette d'inventaire par part ou action (Valeur liquidative)
PART C2 / FR0013358579	1,00	EUR	1 040,88
PART I D2 / FR0010914572	18 993,309	EUR	11 029,84
PART M / FR0013285038	232 854,489	EUR	104,06
PART R C1 / FR0011387299	168 064,67	EUR	1 033,73
PART W / FR0013309218	38 151,962	EUR	10 466,73

Portefeuille titres

Éléments du portefeuille titres	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier.	86,58	84,11
b) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	-	-
c) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'OPC / du fonds d'investissement à vocation générale.	-	-
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 / 4° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.	-	-
e) Les autres actifs	9,19	8,93

Répartition des actifs par devise

Devises (10 principales devises)	Montant	Pourcentage	
	En devise de comptabilité de l'OPC	Actif net	Total des actifs
	EUR		
Euro	698 532 672,09	86,58	84,11
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
-	-	-	-
Autres devises	-	-	-
Total	698 532 672,09	86,58	84,11

Répartition des actifs par pays de résidence de l'émetteur

Pays (10 principaux pays)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	17,60	17,10
Italie	12,54	12,18
Canada	10,82	10,51
Pays-Bas	9,84	9,56
Royaume-Uni	5,99	5,82
États-Unis	4,65	4,52
Suisse	3,37	3,27
Espagne	3,34	3,25
Australie	3,25	3,16
Norvège	2,73	2,65
Autres pays	12,45	12,09
Total	86,58	84,11

Répartition des actifs par secteur économique

Secteur économique (10 principaux secteurs)	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Banques	62,56	60,78
État	11,48	11,15
Expert en finance	6,73	6,54
Services d'investissements	3,43	3,33
Service location et de crédit bail: consommateur	0,75	0,73
Gestionnaires d'actifs	0,63	0,61
Services financiers	0,63	0,61
Construction lourde	0,37	0,36
-	-	-
-	-	-
Autres secteurs	-	-
Total	86,58	84,11

Ventilation des autres actifs par nature

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Parts d'OPC	9,19	8,93
- OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	9,19	8,93
- FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	-	-
- Autres OPC et fonds d'investissements	-	-
Autres actifs	-	-
Total	9,19	8,93

Indication des mouvements intervenus dans la composition du portefeuille titres, au cours de la période de référence

Éléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions / Remboursements
<i>Devise de comptabilité de l'OPC :</i> EUR		
a) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-11° du code monétaire et financier.	491 450 290,89	484 139 713,34
b) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	-	-
c) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'OPC / du fonds d'investissement à vocation générale.	-	-
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 / 4° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.	-	-
e) Les autres actifs	23 529 620,31	8 985 853,82
Total sur la période	514 979 911,20	493 125 567,16

Indication des données chiffrées relatives aux distributions unitaires sur résultat et/ou sur plus ou moins-values nettes réalisées (« PVNR »), versées au cours de la période ou à verser, après déduction des impôts

Date	Catégorie de parts/actions	Devise parts/actions	Nature	Montant net unitaire	Crédit d'impôt unitaire	Montant brut unitaire
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

Information sur les commissions de surperformance (en EUR)

Commission de surperformance (frais variables) : montant et % des frais sur la période	Frais de gestion variables provisionnés		Frais de gestion variables acquis (dus aux rachats)	
		% ⁽¹⁾		% ⁽²⁾
Catégorie de part :				
PART C2 / FR0013358579	-	-	-	-
PART I D2 / FR0010914572	-	-	-	-
PART M / FR0013285038	-	-	-	-
PART R C1 / FR0011387299	-	-	-	-
PART W / FR0013309218	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-

⁽¹⁾ par rapport à l'actif net de l'arrêté comptable.

⁽²⁾ par rapport à l'actif net moyen.

Récapitulatif des cas et conditions dans lesquels le plafonnement des rachats a, au cours de la période, été décidé

Néant.

SFTR

Au cours de l'exercice, l'OPC n'a pas fait l'objet d'opérations relevant de la réglementation SFTR.

Inventaire au 28.06.2024

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
Valeurs mobilières						
Obligation						
XS2573331837	ABN AMRO BANK NV FRN 10/01/2025	PROPRE	6 100 000,00	6 171 999,66	EUR	0,77
XS2747616105	ABN AMRO BANK NV FRN 15/01/2027	PROPRE	6 000 000,00	6 093 978,00	EUR	0,76
XS2694034971	ABN AMRO BANK NV 4.25% 22/09/2025	PROPRE	6 000 000,00	6 017 440,00	EUR	0,75
FR001400L4Y2	ALD SA FRN 06/10/2025	PROPRE	6 000 000,00	6 097 330,83	EUR	0,76
XS2822525205	ASUT NZ BANKING GROUP FRN 21/05/2027	PROPRE	7 000 000,00	7 032 568,67	EUR	0,87
XS2835902839	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA FRN 07/06/2027	PROPRE	3 000 000,00	3 009 189,17	EUR	0,37
XS1717591884	BANCO SANTANDER SA FRN 21/11/2024	PROPRE	10 000 000,00	10 076 633,33	EUR	1,25
XS2293577354	BANCO SANTANDER SA FRN 29/01/2026	PROPRE	8 900 000,00	9 004 470,18	EUR	1,12
XS2838482052	BANK NOVA SCOTIA FRN 10/06/2027	PROPRE	3 000 000,00	3 006 777,00	EUR	0,37
XS2465984289	BANK OF IRELAND GROUP VAR 05/06/2026	PROPRE	4 000 000,00	3 931 107,95	EUR	0,49
XS2696803340	BANK OF MONTREAL FRN 05/09/2025	PROPRE	4 000 000,00	4 022 756,00	EUR	0,50
XS2618508340	BANK OF NOVA SCOTIA FRN 02/05/2025	PROPRE	8 000 000,00	8 078 294,44	EUR	1,00
XS2692247468	BANK OF NOVA SCOTIA FRN 22/09/2025	PROPRE	4 000 000,00	4 016 853,33	EUR	0,50
FR001400OEP0	BANQUE FED CRED MUTUEL FRN 05/03/2027	PROPRE	5 000 000,00	5 036 532,50	EUR	0,62
FR001400HO25	BANQUE FED CRED MUTUEL FRN 28/04/2025	PROPRE	8 000 000,00	8 069 505,78	EUR	1,00
FR0014009A50	BANQUE FED CRED MUTUEL 1% 23/05/2025	PROPRE	2 100 000,00	2 053 791,37	EUR	0,25
XS2815894071	BARCLAYS PLC FRN 08/05/2028	PROPRE	7 150 000,00	7 211 427,44	EUR	0,89
XS2342059784	BARCLAYS PLC VAR 12/05/2026	PROPRE	5 000 000,00	5 063 575,00	EUR	0,63
XS2835763702	BMW INTL INVESTMENT BV FRN 05/06/2026	PROPRE	4 000 000,00	4 010 262,00	EUR	0,50
XS2485554088	BNP PARIBAS ISSUANCE BV FRN 27/08/2025	PROPRE	5 000 000,00	5 067 030,56	EUR	0,63
FR0013434776	BNP PARIBAS VAR 15/07/2025	PROPRE	7 000 000,00	7 025 426,83	EUR	0,87
FR0013398070	BNP PARIBAS VAR 23/01/2027	PROPRE	3 000 000,00	2 947 343,03	EUR	0,37
XS1793252419	BNP PARIBAS 1.25% 19/03/2025	PROPRE	2 900 000,00	2 858 141,08	EUR	0,35
XS1190632999	BNP PARIBAS 2.375% 17/02/2025	PROPRE	7 000 000,00	6 985 195,96	EUR	0,87
FR001400OGI0	BPCE SA FRN 06/03/2026	PROPRE	3 000 000,00	3 009 557,67	EUR	0,37

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
FR001400OHE7	BPCE SA FRN 08/03/2027	PROPRE	5 000 000,00	5 028 037,50	EUR	0,62
FR0013429073	BPCE SA 0.625% 26/09/2024	PROPRE	5 000 000,00	4 985 557,10	EUR	0,62
XS2752874821	CA AUTO BANK SPA IE FRN 26/01/2026	PROPRE	3 400 000,00	3 447 185,67	EUR	0,43
XS2200150766	CAIXABANK SA VAR 07/10/2026	PROPRE	5 000 000,00	4 883 980,33	EUR	0,61
XS2634071489	CANADIAN IMPERIAL BANK FRN 09/06/2025	PROPRE	9 500 000,00	9 553 202,64	EUR	1,18
XS2793782611	CANADIAN IMPERIAL BANK FRN 27/03/2026	PROPRE	5 000 000,00	5 005 495,83	EUR	0,62
XS2819338091	CITIGROUP INC FRN 14/05/2028	PROPRE	2 800 000,00	2 817 367,16	EUR	0,35
XS1859010685	CITIGROUP INC VAR 24/07/2026	PROPRE	2 000 000,00	1 980 696,72	EUR	0,25
DE000CB0HRQ9	COMMERZBAK AG VAR 24/03/2026	PROPRE	1 900 000,00	1 860 831,11	EUR	0,23
DE000CZ45YA3	COMMERZBANK AG FRN 12/03/2027	PROPRE	1 100 000,00	1 107 005,17	EUR	0,14
XS2712747182	COOPERATIEVE RABOBANK UA FRN 03/11/2026	PROPRE	9 000 000,00	9 144 615,00	EUR	1,13
FR001400D0Y0	CRED AGRICOLE SA VAR 12/10/2026	PROPRE	8 000 000,00	8 244 979,67	EUR	1,02
FR0013508512	CRED AGRICOLE SA VAR 22/04/2026	PROPRE	2 000 000,00	1 958 170,41	EUR	0,24
FR001400GDG7	CREDIT AGRICOLE SA FRN 07/03/2025	PROPRE	10 000 000,00	10 043 377,78	EUR	1,24
CH0591979635	CREDIT SUISSE GROUP AG FRN 16/01/2026	PROPRE	10 000 000,00	10 140 197,50	EUR	1,26
CH0537261858	CREDIT SUISSE GROUP AG VAR 02/04/2026	PROPRE	6 000 000,00	6 013 876,44	EUR	0,75
CH1174335732	CREDIT SUISSE GROUP AG VAR 13/10/2026	PROPRE	6 000 000,00	5 958 898,85	EUR	0,74
XS2687832886	DAIMLER TRUCK FI FRN 18/03/2025	PROPRE	8 000 000,00	8 030 393,33	EUR	1,00
XS2798276270	DANSKE BANK AS FRN 10/04/2027	PROPRE	6 050 000,00	6 120 489,39	EUR	0,76
XS2573569220	DANSKE BANK AS VAR 12/01/2027	PROPRE	6 000 000,00	6 142 066,89	EUR	0,76
XS2046595836	DANSKE BANK AS 0.5% 27/08/2025	PROPRE	7 000 000,00	6 991 774,81	EUR	0,87
XS2588099478	DNB BANK ASA VAR 16/02/2027	PROPRE	1 442 000,00	1 458 754,58	EUR	0,18
XS2486092492	DNB BANK ASA VAR 31/05/2026	PROPRE	6 921 000,00	6 800 883,67	EUR	0,84
DE000DJ9ABK3	DZ BANK AG FRN 16/11/2026	PROPRE	8 000 000,00	8 091 904,00	EUR	1,00
DE000DW6DA51	DZ BANK AG FRN 27/10/2025	PROPRE	7 000 000,00	7 065 888,67	EUR	0,88
XS2742659738	FED CAISSES DESJARDINS FRN 17/01/2026	PROPRE	3 900 000,00	3 954 089,53	EUR	0,49
XS1509006380	GOLDMAN SACHS GROUPE INC 1.25% 01/05/2025	PROPRE	9 000 000,00	8 841 899,59	EUR	1,10
XS2697966690	ING BANK NV FRN 02/10/2026	PROPRE	5 900 000,00	5 948 734,00	EUR	0,74
XS2483607474	ING GROEP NV VAR 23/05/2026	PROPRE	6 000 000,00	5 922 892,60	EUR	0,73

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
XS2413696761	ING GROEP NV VAR 29/11/25	PROPRE	3 000 000,00	2 956 553,11	EUR	0,37
XS1771838494	ING GROEP NV 1.125% 14/02/2025	PROPRE	5 000 000,00	4 941 112,70	EUR	0,61
XS2049154078	ING GROEP VAR 03/09/2025	PROPRE	12 700 000,00	12 626 566,93	EUR	1,57
XS2443920249	ING GROUP NV VAR 16/02/2027	PROPRE	1 500 000,00	1 448 338,44	EUR	0,18
XS2804483381	INTESA SANPAOLO SPA FRN 16/04/2027	PROPRE	4 500 000,00	4 545 093,00	EUR	0,56
XS2719281227	INTESA SANPAOLO SPA FRN 16/11/2025	PROPRE	11 000 000,00	11 128 335,78	EUR	1,38
XS2597970800	INTESA SANPAOLO SPA FRN 17/03/2025	PROPRE	10 000 000,00	10 044 720,83	EUR	1,25
XS2625195891	INTESA SANPAOLO SPA 4% 19/05/2026	PROPRE	1 900 000,00	1 919 611,64	EUR	0,24
XS2838379639	JPMORGAN CHASE & CO FRN 06/06/2028	PROPRE	5 000 000,00	5 025 210,00	EUR	0,62
BE0002950310	KBC GROUP NV VAR 06/06/2026	PROPRE	7 000 000,00	7 061 988,36	EUR	0,88
BE0002846278	KBC GROUP NV VAR 29/03/2026	PROPRE	5 000 000,00	4 930 720,55	EUR	0,61
BE0974423569	KBC GROUP NV VAR 29/06/2025	PROPRE	3 000 000,00	3 000 588,90	EUR	0,37
XS2775724862	LLOYDS BANKING GROUP PLC FRN 05/03/2027	PROPRE	1 200 000,00	1 208 545,80	EUR	0,15
XS2148623106	LLOYDS BANKING GROUP PLC VAR 01/04/2026	PROPRE	3 000 000,00	3 018 335,75	EUR	0,37
XS2706264087	MACQUARIE BANK LTD FRN 20/10/2025	PROPRE	10 000 000,00	10 134 790,83	EUR	1,26
DE000A3LW3B3	MERCEDES BENZ INT FINCE FRN 09/04/2026	PROPRE	3 000 000,00	3 028 121,00	EUR	0,38
DE000A3LNY11	MERCEDES BNZ INT FINCE FRN 29/09/2025	PROPRE	6 000 000,00	6 005 614,67	EUR	0,74
XS2790333616	MORGAN STANLEY FRN 19/03/2027	PROPRE	5 950 000,00	5 975 970,59	EUR	0,74
XS2446386356	MORGAN STANLEY VAR 08/05/2026	PROPRE	13 000 000,00	12 857 895,75	EUR	1,59
XS2780858994	NATIONAL BANK OF CANADA FRN 06/03/2026	PROPRE	3 950 000,00	3 965 836,43	EUR	0,49
XS2614612930	NATIONAL BANK OF CANADA FRN 21/04/2025	PROPRE	5 000 000,00	5 065 988,47	EUR	0,63
XS2576255751	NATWEST MARKETS FRN 13/01/2026	PROPRE	11 000 000,00	11 232 499,67	EUR	1,39
XS2745115597	NATWEST MARKETS PLC FRN 09/01/2026	PROPRE	4 600 000,00	4 667 827,00	EUR	0,58
XS2584643113	NORDEA BANK ABP VAR 10/02/2026	PROPRE	5 000 000,00	5 064 066,26	EUR	0,63
XS2722262966	OP CORPORATE BANK PLC FRN 21/11/2025	PROPRE	10 000 000,00	10 080 983,33	EUR	1,25
XS2794477518	OP CORPORATE BANK PLC FRN 28/03/2027	PROPRE	4 450 000,00	4 456 488,10	EUR	0,55
IT0005311508	REPUBLIC OF ITALY FRN 15/04/2025	PROPRE	22 000 000,00	22 391 512,00	EUR	2,78
IT0005252520	REPUBLIC OF ITALY FRN 15/10/2024	PROPRE	30 000 000,00	30 426 330,00	EUR	3,77
XS2853494602	ROYAL BANK OF CANADA FRN 02/07/2028	PROPRE	7 350 000,00	7 352 131,50	EUR	0,91

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
XS2577030708	ROYAL BANK OF CANADA FRN 17/01/2025	PROPRE	7 000 000,00	7 076 970,44	EUR	0,88
XS2080205367	ROYAL BANK OF SCOTLAND 0.75% 15/11/2025	PROPRE	5 000 000,00	4 965 515,57	EUR	0,62
XS1788515606	ROYAL BK SCOTLAND GRP PLC VAR 02/03/2026	PROPRE	4 000 000,00	3 966 677,26	EUR	0,49
XS2441296923	SANTANDER CONSUMER BANK AS 0.50% 11/08/2025	PROPRE	2 900 000,00	2 814 141,30	EUR	0,35
XS2050945984	SANTANDER CONSUMER BANK 0.125% 11/09/2024	PROPRE	7 000 000,00	6 958 892,60	EUR	0,86
XS2813108870	SKANDINAVISKA ENSKILDA FRN 03/05/2027	PROPRE	3 050 000,00	3 072 815,37	EUR	0,38
XS2635183069	SKANDINAVISKA ENSKILDA FRN 13/06/2025	PROPRE	7 000 000,00	7 038 576,03	EUR	0,87
FR001400F315	SOCIETE GENERALE FRN 13/01/2025	PROPRE	9 000 000,00	9 100 422,00	EUR	1,13
FR001400N9V5	SOCIETE GENERALE FRN 19/01/2026	PROPRE	3 100 000,00	3 136 375,92	EUR	0,39
FR0014006IU2	SOCIETE GENERALE VAR 17/11/2026	PROPRE	5 000 000,00	4 759 893,44	EUR	0,59
XS2057872595	SPARE BANK 1 OESTLANDET 0.25% 30/09/2024	PROPRE	4 000 000,00	3 970 460,98	EUR	0,49
XS2782828649	SVENSKA HANDELSBANKEN FRN 08/03/2027	PROPRE	5 000 000,00	5 020 898,61	EUR	0,62
XS2782117118	TORONTO DOMINION BANK FRN 16/02/2027	PROPRE	6 000 000,00	6 049 196,33	EUR	0,75
XS2803392021	TORONTO DOMINION BANK FRN 16/04/2026	PROPRE	6 000 000,00	6 057 832,00	EUR	0,75
XS2577740157	TORONTO DOMINION BANK FRN 20/01/2025	PROPRE	6 000 000,00	6 066 439,50	EUR	0,75
XS2717421429	TOYOTA FINANCE AUSTRALIA FRN 13/11/2025	PROPRE	9 000 000,00	9 089 845,00	EUR	1,13
XS2800795291	UBS AG LONDON FRN 12/04/2026	PROPRE	2 000 000,00	2 017 919,00	EUR	0,25
CH0343366842	UBS GROUP AG VAR 17/07/2025	PROPRE	5 000 000,00	5 053 988,52	EUR	0,63
XS2021993212	UNICREDIT SPA VAR 03/07/2025	PROPRE	7 000 000,00	7 113 929,21	EUR	0,88
IT0005598971	UNICREDIT SPA VAR 11/06/2028	PROPRE	3 650 000,00	3 652 443,50	EUR	0,45
FR001400Q0V1	VINCI SA FRN 13/05/2026	PROPRE	3 000 000,00	3 019 087,50	EUR	0,37
Total Obligation				630 004 531,19		78,09
O.P.C.V.M.						
FR0013090669	ALZ CASH FACILITY DISTRIBUTION I3	PROPRE	775,00	74 164 970,79	EUR	9,19
Total O.P.C.V.M.				74 164 970,79		9,19
Total Valeurs mobilières				704 169 501,98		87,28
Swap de Taux						
SWAP04107083	fd1bbaa2234c4539#S_2	PROPRE	8 000 000,00	4 093,87	EUR	0,00
SWAP04097136	f72de99a60c94430#S_2	PROPRE	4 000 000,00	7 088,63	EUR	0,00

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
SWAP04097133	4ec4777631e1411f#S_2	PROPRE	12 000 000,00	17 313,93	EUR	0,00
Total Swap de Taux				28 496,43		0,00
Liquidites						
APPELS DE MARGES						
	Appel de marge EUR	PROPRE	234 048,57	234 048,57	EUR	0,03
	Appel marge EUR	PROPRE	9 795,00	9 795,00	EUR	0,00
Total APPELS DE MARGES				243 843,57		0,03
AUTRES						
	Prov Int Neg CptCash	PROPRE	101 590,01	101 590,01	EUR	0,01
Total AUTRES				101 590,01		0,01
BANQUE OU ATTENTE						
	Ach diff titres EUR	PROPRE	-23 286 327,11	-23 286 327,11	EUR	-2,89
	Banque EUR JPM	PROPRE	267,50	267,50	EUR	0,00
	Banque EUR SGP	PROPRE	56 853 746,58	56 853 746,58	EUR	7,05
Total BANQUE OU ATTENTE				33 567 686,97		4,16
DEPOSIT DE GARANTIE						
	Deposit OTC Verse	PROPRE	179 521,20	179 521,20	EUR	0,02
	Gar sur MAT ferm V	PROPRE	197 346,40	197 346,40	EUR	0,02
Total DEPOSIT DE GARANTIE				376 867,60		0,05
FRAIS DE GESTION						
	PrComGestAdm	PROPRE	-9 849,40	-9 849,40	EUR	-0,00
	PrComGestAdm	PROPRE	-0,02	-0,02	EUR	-0,00
	PrComGestAdm	PROPRE	-8 764,81	-8 764,81	EUR	-0,00
	PrComGestAdm	PROPRE	-1 393,35	-1 393,35	EUR	-0,00
	PrComGestAdm	PROPRE	-3 575,13	-3 575,13	EUR	-0,00
	PrComGestFin	PROPRE	-30 902,03	-30 902,03	EUR	-0,00
	PrComGestFin	PROPRE	-0,05	-0,05	EUR	-0,00
	PrComGestFin	PROPRE	-18 212,01	-18 212,01	EUR	-0,00
	PrComGestFin	PROPRE	-2 484,84	-2 484,84	EUR	-0,00

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
	PrComGestFin	PROPRE	-36 880,61	-36 880,61	EUR	-0,00
Total FRAIS DE GESTION				-112 062,25		-0,01
Total Liquidites				34 177 925,90		4,24
Futures						
Taux (Livraison du sous-jacent)						
DU100924	EURO SCHATZ 0924	PROPRE	300,00	-9 795,00	EUR	-0,00
Total Taux (Livraison du sous-jacent)				-9 795,00		-0,00
Total Futures				-9 795,00		-0,00
Derives de credit						
CDS						
CDS-00098257	CDSREF/15,000,000.	APROT	-15 000 000,00	-262 545,00	EUR	-0,03
Total CDS				-262 545,00		-0,03
Total Derives de credit				-262 545,00		-0,03
Creances negociables						
Interets precomptes.						
FR0128199835	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL ZCP 13/09/2024	PROPRE	8 000 000,00	7 939 370,40	EUR	0,98
FR0128202464	BANQUE STELLANTIS FRANCE ZCP 20/09/2024	PROPRE	5 000 000,00	4 958 218,50	EUR	0,61
FR0128479518	BFCM ZCP 14/02/2025	PROPRE	5 000 000,00	4 884 381,50	EUR	0,61
IT0005581506	BOT 0% 31/07/2024	PROPRE	10 000 000,00	9 969 300,00	EUR	1,24
FR0128379411	BTF 0% 14/08/2024	PROPRE	20 000 000,00	19 910 200,00	EUR	2,47
FR0128227784	BTF 0% 18/09/2024	PROPRE	10 000 000,00	9 920 300,00	EUR	1,23
XS2694869707	INTESA SANPOLO BK ZCP 18/09/2024	PROPRE	6 000 000,00	5 951 016,00	EUR	0,74
XS2651968450	LLOYDS BANK PLC ZCP 11/07/2024	PROPRE	5 000 000,00	4 995 354,50	EUR	0,62
Total Interets precomptes.				68 528 140,90		8,49
Total Creances negociables				68 528 140,90		8,49
Coupons						
Obligation						
XS2697966690	ING BANK NV FRN 26	ACHLIG	59,00	68 126,64	EUR	0,01
BE0974423569	KBC VAR 2025	ACHLIG	30,00	86 250,00	EUR	0,01
Total Obligation				154 376,64		0,02
Total Coupons				154 376,64		0,02
Total ALLIANZ EURO OBLIG COURT TERME ISR				806 786 101,85		100,00