

BFT AUREUS

Informations semestrielles Septembre 2018

OPCVM de BFT INVESTMENT MANAGERS

Société de gestion : BFT INVESTMENT MANAGERS

Sous déléataire de gestion comptable en titre : CACEIS FUND ADMINISTRATION FRANCE

Dépositaire : CACEIS BANK

Commissaire aux comptes : KPMG AUDIT

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

OPCVM BFT AUREUS

Etat du patrimoine en EUR

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier.	10 734 349 507,35
b) Avoirs bancaires	30 718 888,26
c) Autres actifs détenus par l'OPC	1 295 040 979,35
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	12 060 109 374,96
e) Passif	-2 876 230,30
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	12 057 233 144,66

* Les montants sont signés

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

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
BFT AUREUS I-D	D	212 234,26	2 129,677	99,66
BFT AUREUS I-C	C	4 307 202 510,52	39 720 766,668	108,44
BFT AUREUS I2-D	D	285 151 079,97	28 612,000	9 966,14
BFT AUREUS I2-C	C	7 464 667 319,91	748 849,600	9 968,18

Eléments du portefeuille titres

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	79,44	79,43
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	9,58	9,58
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		

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

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

OPCVM BFT AUREUS

Répartition des actifs du A), B), C), D) du portefeuille titres, par devise

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Euro	EUR	10 734 349 507,35	89,03	89,01
TOTAL		10 734 349 507,35	89,03	89,01

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

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

Répartition des actifs du A), B), C), D) du portefeuille titres, par pays de résidence de l'émetteur

Pays	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
France	32,13	32,13
Royaume uni	16,02	16,02
Irlande	6,86	6,86
Luxembourg	5,90	5,90
Etats unis americque	5,36	5,36
Espagne	4,99	4,99
Pays-bas	4,19	4,19
Suede	3,44	3,44
Allemagne	2,62	2,62
Chine	1,83	1,82
Italie	1,28	1,28
Danemark	1,18	1,18
Australie	1,17	1,17
Belgique	0,83	0,83
Emirats arabes unis	0,52	0,52
Canada	0,46	0,46
Departement de la reunion	0,25	0,25
TOTAL	89,03	89,01

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

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

Répartition des autres actifs du E) du portefeuille titres, par nature

Nature d'actifs	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Organismes de placement collectif		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays		
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE		
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés		
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés		
Autres organismes non européens		
Autres		
TOTAL		

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

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

Mouvements dans le portefeuille titres en cours de période en EUR

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	3 405 246 096,18	6 067 670 807,54
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	335 339 309,15	384 600 000,00
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		

Distribution en cours de période

	Part	Montant net unitaire €	Crédit d'impôt (1) €	Montant brut unitaire (2) €
Dividendes versés				
	BFT AUREUS I2-D			
	BFT AUREUS I-D			
Dividendes à verser				
	BFT AUREUS I2-D			
	BFT AUREUS I-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)

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

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Dépôts				
DEPOT SWISSLIFE 2/19	EUR	15 000 000	14 997 188,33	0,12
D0089995	EUR	200 000 000	199 934 201,89	1,66
TOTAL Dépôts			214 931 390,22	1,78
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
DEKABANK DEUTSCHE GIROZENTRALE E3R+0.19% 30-01-19	EUR	50 000 000	50 112 500,00	0,42
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG E3R+0.35% 11-10-19	EUR	154 000 000	154 361 168,50	1,27
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG E3R+0.35% 16-07-20	EUR	51 600 000	51 603 159,07	0,43
VOLKSWAGEN LEASING E3R+0.35% 06-07-19	EUR	60 100 000	60 190 707,59	0,50
TOTAL ALLEMAGNE			316 267 535,16	2,62
AUSTRALIE				
MACQUARIE E3R+0.5% 23-03-20	EUR	60 000 000	60 424 810,00	0,50
TOTAL AUSTRALIE			60 424 810,00	0,50
CANADA				
BANK OF NOVA SCOTIA TORONTO E3R+0.5% 03-04-20	EUR	55 000 000	55 445 089,03	0,46
TOTAL CANADA			55 445 089,03	0,46
DANEMARK				
DANSKE BANK AS E3R+0.15% 11-01-19	EUR	60 000 000	60 060 000,00	0,50
TOTAL DANEMARK			60 060 000,00	0,50
ESPAGNE				
IBERDROLA FINANZAS SAU E3R+0.35% 05-02-20	EUR	130 000 000	130 526 156,94	1,08
TOTAL ESPAGNE			130 526 156,94	1,08
ETATS UNIS AMERIQUE				
AT T E3R+0.4% 03-08-20	EUR	120 000 000	120 255 660,00	1,01
CA LA E3R+0.25% 08-03-19	EUR	20 300 000	20 361 813,50	0,17
CITIGROUP GLOBAL MKTS E3R+0.35% 27-03-20	EUR	236 000 000	236 803 009,67	1,97
FORD MOTOR CREDIT E3R+0.35% 12-12-19	EUR	105 000 000	105 269 377,50	0,87
MCKESSON E3R+0.15% 12-02-20	EUR	13 100 000	13 152 400,00	0,11
PROLOGIS LP E3R+0.25% 29-01-20	EUR	54 000 000	54 200 340,00	0,45
THERMO FISHER SCIENTIFIC E3R+0.23% 24-07-19	EUR	9 600 000	9 630 048,00	0,08
UNITED TECHNOLOGIES E3R+0.15% 13-11-19	EUR	26 800 000	26 923 012,00	0,22
TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE			586 595 660,67	4,88
FRANCE				
FRAN E3R+0.3% 28-06-19	EUR	10 400 000	10 421 320,00	0,09
FRAN E3R+0.33% 13-07-20	EUR	32 800 000	32 800 647,80	0,27

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
GRUPE DANONE E3R+0.15% 03-11-18	EUR	49 900 000	49 915 439,06	0,41
TOTAL FRANCE			93 137 406,86	0,77
IRLANDE				
FCA BANK SPA IRISH BRANCH E3R+0.33% 22-01-20	EUR	45 000 000	44 784 776,25	0,37
FCA BANK SPA IRISH BRANCH E3R+0.4% 27-03-19	EUR	70 000 000	70 001 055,83	0,58
INTESA BANK IRELAND E3R+0.37% 01-06-19	EUR	178 000 000	178 328 098,50	1,49
INTESA BANK IRELAND E3R+0.57% 23-01-19	EUR	107 000 000	107 285 930,75	0,89
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC E3R+0.25% 25-09-19	EUR	47 000 000	46 961 460,00	0,39
TOTAL IRLANDE			447 361 321,33	3,72
ITALIE				
SNAM E3R+0.4% 29-01-20 EMTN	EUR	87 000 000	87 507 016,67	0,72
UBI BANCA UNIONE DI BANCHE ITALIANE E3R+0.44% STEPUP 07-11-1	EUR	67 000 000	67 026 230,50	0,56
TOTAL ITALIE			154 533 247,17	1,28
LUXEMBOURG				
INTE BANK LUXEMBOURG E3R+0.25% 25-09-19	EUR	172 000 000	172 077 400,00	1,43
INTE BANK LUXEMBOURG E3R+0.35% 13-04-20	EUR	85 000 000	84 996 909,31	0,70
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 0.28% 16-08-19	EUR	40 000 000	40 020 000,00	0,33
TOTAL LUXEMBOURG			297 094 309,31	2,46
PAYS-BAS				
ROYAL PHILIPS ELECTRONICS NV E3R+0.2% 06-09-19	EUR	4 300 000	4 317 329,00	0,04
THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE I BV E3R+0.3% 07-08-20	EUR	35 000 000	35 013 650,00	0,29
VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV E3R+0.35% 30-03-19	EUR	45 900 000	46 005 651,35	0,38
TOTAL PAYS-BAS			85 336 630,35	0,71
ROYAUME UNI				
BARCLAYS BANK PLC ZCP 16-05-19	EUR	50 000 000	50 093 675,00	0,41
HITACHI CAPITAL UK PLC E3R+0.44% 19-09-19	EUR	30 000 000	30 069 809,17	0,25
TOTAL ROYAUME UNI			80 163 484,17	0,66
SUEDE				
SCANIA CV AB E3R+0.35% 06-09-19	EUR	24 800 000	24 865 984,53	0,20
VOLVO TREASURY AB E3R+0.35% 12-12-18	EUR	14 000 000	14 010 911,04	0,12
TOTAL SUEDE			38 876 895,57	0,32
			TOTAL Obligations & val. ass. ng. sur mar. régl. ou ass.	19,96
			TOTAL Obligations et valeurs assimilées	19,96
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
BELGIQUE				
BNP PARI FORT SA ZCP 05-03-19	EUR	50 000 000	50 059 638,41	0,42
HOLC FINA BELG SA ZCP 07-12-18	EUR	40 000 000	40 016 011,96	0,33

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
HOLC FINA BELG SA ZCP 26-11-18	EUR	10 000 000	10 003 656,89	0,08
TOTAL BELGIQUE			100 079 307,26	0,83
CHINE				
ICBC ZCP 21-03-19	EUR	180 000 000	180 083 632,19	1,49
TOTAL CHINE			180 083 632,19	1,49
DANEMARK				
JYSK B OIS+0.045% 22-03-19	EUR	82 000 000	81 843 840,80	0,68
TOTAL DANEMARK			81 843 840,80	0,68
DEPARTEMENT DE LA REUNION				
CRCA D OIS+0.06% 01-02-19	EUR	30 000 000	29 938 632,15	0,25
TOTAL DEPARTEMENT DE LA REUNION			29 938 632,15	0,25
FRANCE				
AIR LIQU FINA ZCP 10-04-19	EUR	60 000 000	60 090 862,39	0,50
BANK OF CHIN PARI ZCP 11-01-19	EUR	85 000 000	85 028 324,21	0,71
BARC BANK PLC PARI ZCP 28-02-19	EUR	250 000 000	250 238 852,99	2,08
BFCM B OIS+0.08% 17-04-19	EUR	350 000 000	349 542 255,32	2,90
BFCM B OIS+0.08% 29-03-19	EUR	54 000 000	53 921 391,75	0,45
BFCM B OIS+0.14% 26-07-19	EUR	173 000 000	172 929 975,94	1,43
BNP PA OIS+0.13% 11-07-19	EUR	150 000 000	149 919 939,58	1,24
BPCE OIS+0.07% 16-01-19	EUR	190 000 000	189 602 052,92	1,57
BPCE OIS+0.07% 31-12-18	EUR	134 000 000	133 731 349,69	1,11
BPCE OIS+0.08% 11-01-19	EUR	200 000 000	199 589 198,56	1,66
BPCE OIS+0.09% 31-01-19	EUR	288 700 000	288 175 407,80	2,39
BPCE OIS+0.12% 11-03-19	EUR	39 000 000	38 986 411,27	0,32
BPCE OIS+0.16% 02-08-19	EUR	30 000 000	29 990 135,20	0,25
BRED E3R+0.27% 29-10-19	EUR	20 100 000	20 098 241,25	0,17
CA CON E3R+0.27% 28-11-18	EUR	31 000 000	31 048 352,01	0,26
CRCA A OIS+0.06% 01-02-19	EUR	150 000 000	149 694 420,12	1,24
CRCA N OIS+0.06% 01-02-19	EUR	50 000 000	49 898 140,04	0,41
CRCA S OIS+0.06% 01-02-19	EUR	100 000 000	99 796 280,09	0,83
CRCA S OIS+0.06% 04-02-19	EUR	50 000 000	49 899 382,58	0,41
CRCA S OIS+0.06% 31-01-19	EUR	40 000 000	39 917 880,06	0,33
CRCA T OIS+0.06% 01-02-19	EUR	30 000 000	29 938 632,15	0,25
CRED A OIS+0.035% 18-12-18	EUR	426 000 000	424 989 512,97	3,52
CRED A OIS+0.145% 19-09-19	EUR	120 000 000	119 991 894,10	1,00
CRED D OIS+0.28% 15-02-19	EUR	206 000 000	206 428 369,45	1,71
CRED L OIS+0.255% 25-09-20	EUR	30 000 000	29 999 454,28	0,25
CRED M OIS+0.06% 29-01-19	EUR	100 000 000	99 793 159,31	0,83

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CRED M OIS+0.14% 27-08-19	EUR	80 000 000	79 982 758,22	0,66
ELEC DE FRAN EDF ZCP 05-04-19	EUR	150 000 000	150 195 088,40	1,25
LCL LE E3R+0.27% 30-11-18	EUR	30 000 000	30 040 408,23	0,25
SG OIS+0.15% 20-11-19	EUR	168 000 000	167 958 481,32	1,39
TOTAL FRANCE			3 781 416 612,20	31,37
LUXEMBOURG				
AGRICULTURAL BAN 240119 FIX -0.045	EUR	79 000 000	79 005 325,18	0,66
MEDI INTE LUX ZCP 31-01-19	EUR	165 000 000	165 116 579,09	1,36
TOTAL LUXEMBOURG			244 121 904,27	2,02
PAYS-BAS				
ING BA OIS+0.05% 21-03-19	EUR	230 000 000	229 615 409,97	1,90
TOTAL PAYS-BAS			229 615 409,97	1,90
ROYAUME UNI				
BARCLAYS BANK PLC ZCP 29-01-19	EUR	145 000 000	145 101 788,90	1,20
GOLD SACH INTE BAN ZCP 27-08-19	EUR	225 000 000	224 999 999,79	1,86
GOLD SACH INTE BAN ZCP 29-03-19	EUR	150 000 000	150 123 036,55	1,25
IMPE BRAN FINA PLC ZCP 27-09-19	EUR	20 000 000	20 019 070,95	0,17
LLOY B OIS+0.035% 23-01-19	EUR	98 000 000	97 777 308,61	0,81
LLOYDS BANK PLC ZCP 07-03-19	EUR	223 000 000	223 299 512,38	1,85
LLOYDS BANK PLC ZCP 15-03-19	EUR	124 000 000	124 173 880,69	1,03
LLOYDS BANK PLC ZCP 25-02-19	EUR	78 000 000	78 099 680,77	0,65
MIZU INTE PLC ZCP 25-01-19	EUR	50 000 000	50 043 838,07	0,42
UBS BK OF SWIT LON ZCP 14-01-19	EUR	125 000 000	125 109 368,52	1,04
UNIC SPAL BRAN ZCP 22-02-19	EUR	130 000 000	130 121 945,08	1,08
TOTAL ROYAUME UNI			1 368 869 430,31	11,36
SUEDE				
SVEN HAND AB ZCP 01-02-19	EUR	100 000 000	100 106 645,28	0,83
SVEN HAND AB ZCP 05-02-19	EUR	50 000 000	50 078 535,08	0,42
TOTAL SUEDE			150 185 180,36	1,25
			TOTAL Titres de créances négo. sur marchés régl. ou ass.	51,15
Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
AUSTRALIE				
CRED SUIS AUST ZCP 25-01-19	EUR	80 000 000	80 079 032,76	0,66
TOTAL AUSTRALIE			80 079 032,76	0,66
CHINE				
CHIN CONS BANK COR ZCP 02-11-18	EUR	40 000 000	40 006 009,43	0,33
TOTAL CHINE			40 006 009,43	0,33

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
EMIRATS ARABES UNIS				
ABU DHAB COME BANK ZCP 05-10-18	EUR	63 000 000	63 001 751,16	0,52
TOTAL EMIRATS ARABES UNIS			63 001 751,16	0,52
ESPAGNE				
BANCO SANTANDER SA ZCP 25-02-19	EUR	145 000 000	145 188 907,22	1,20
SANT CONS FINA SA ZCP 02-05-19	EUR	88 000 000	88 131 200,26	0,73
SANT CONS FINA SA ZCP 29-07-19	EUR	195 000 000	195 283 190,14	1,62
SANT CONS FINA SA ZCP 30-01-19	EUR	43 000 000	43 038 630,82	0,36
TOTAL ESPAGNE			471 641 928,44	3,91
ETATS UNIS AMERIQUE				
VOLK GROU AMER FIN ZCP 01-02-19	EUR	60 000 000	60 032 707,12	0,50
TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE			60 032 707,12	0,50
IRLANDE				
INTE SANP BANK IRE ZCP 06-03-19	EUR	58 000 000	58 072 371,14	0,48
UNIC BANK IREL PLC ZCP 28-03-19	EUR	321 000 000	321 413 671,90	2,67
TOTAL IRLANDE			379 486 043,04	3,15
LUXEMBOURG				
CHIN CONS BANK COR ZCP 13-03-19	EUR	120 000 000	120 071 877,13	1,00
MOHA CAPI LUXE SA ZCP 12-11-18	EUR	50 000 000	50 012 544,81	0,41
TOTAL LUXEMBOURG			170 084 421,94	1,41
PAYS-BAS				
ING BANK NV ZCP 26-02-19	EUR	140 000 000	140 175 251,30	1,16
VOLK INTE FINA NV ZCP 11-01-19	EUR	30 000 000	30 008 462,44	0,25
VOLK INTE FINA NV ZCP 17-04-19	EUR	20 000 000	20 008 967,92	0,17
TOTAL PAYS-BAS			190 192 681,66	1,58
ROYAUME UNI				
BANK OF CHIN LTD L ZCP 13-03-19	EUR	53 000 000	53 015 172,99	0,44
BARCLAYS BANK PLC ZCP 31-07-19	EUR	119 000 000	119 213 589,72	0,99
DEUT BANK AG LOND ZCP 23-11-18	EUR	116 000 000	116 029 045,25	0,96
IMPE BRAN FINA PLC ZCP 01-02-19	EUR	94 000 000	94 058 652,70	0,78
UBS BK OF SWITZERLAND LN 130819 FX -0.24	EUR	100 000 000	100 208 414,13	0,83
TOTAL ROYAUME UNI			482 524 874,79	4,00
SUEDE				
SVEN HAND AB ZCP 19-03-19	EUR	225 000 000	225 323 560,94	1,87
TOTAL SUEDE			225 323 560,94	1,87
TOTAL Titres de créances non ng. sur mar. régl. ou ass.			2 162 373 011,28	17,93
TOTAL Titres de créances			8 328 526 960,79	69,08

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
AMUNDI 3 M I2	EUR	64 164	639 302 633,81	5,30
BFT MONETAIRE COURT TERME I2 C	EUR	15 090	149 991 732,90	1,24
BFT SEQUIN ISRI2 C D SI	EUR	6 537	65 124 274,17	0,54
BFT STATERE IC	EUR	2 250	225 142 803,95	1,87
TOTAL FRANCE			1 079 561 444,83	8,95
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			1 079 561 444,83	8,95
TOTAL Organismes de placement collectif			1 079 561 444,83	8,95
Instruments financiers à terme				
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				
OIS/0.0/FIX/-0.328	EUR	94 161 853	-26 038,02	
OIS/0.0/FIX/-0.331	EUR	30 025 379	-7 821,89	
OIS/0.0/FIX/-0.334	EUR	85 000 000	-19 576,82	
OIS/0.0/FIX/-0.334	EUR	125 367 605	-29 075,87	
OIS/0.0/FIX/-0.337	EUR	43 122 083	-7 687,25	
OIS/0.0/FIX/-0.337	EUR	78 964 071	-14 804,65	
OIS/0.0/FIX/-0.338	EUR	80 243 405	-14 115,88	
OIS/0.0/FIX/-0.338	EUR	165 343 662	-28 904,94	
OIS/0.0/FIX/-0.339	EUR	50 134 988	-8 147,24	
OIS/0.0/FIX/-0.34	EUR	100 314 430	-15 563,06	
OIS/0.0/FIX/-0.341	EUR	50 152 547	-7 509,85	
OIS/0.0/FIX/-0.342	EUR	78 229 385	-12 429,54	
OIS/0.0/FIX/-0.342	EUR	145 433 796	-23 107,37	
OIS/0.0/FIX/-0.343	EUR	130 382 309	-18 848,71	
OIS/0.0/FIX/-0.344	EUR	140 418 838	-20 369,77	
OIS/0.0/FIX/-0.345	EUR	50 136 873	-6 582,08	
OIS/0.0/FIX/-0.345	EUR	58 141 089	-7 600,96	
OIS/0.0/FIX/-0.345	EUR	134 353 199	-18 198,24	
OIS/0.0/FIX/-0.346	EUR	199 514 414	-24 609,61	
OIS/0.0/FIX/-0.346	EUR	223 678 491	-27 999,98	
OIS/0.0/FIX/-0.346	EUR	296 767 267	-36 707,64	
OIS/0.0/FIX/-0.348	EUR	100 243 256	876,82	
OIS/0.0/FIX/-0.349	EUR	50 000 000	-3 315,06	
OIS/0.0/FIX/-0.349	EUR	53 032 172	-4 605,87	
OIS/0.0/FIX/-0.349	EUR	150 252 424	-13 126,55	

Portefeuille titres détaillé en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OIS/0.0/FIX/-0.35	EUR	88 223 008	-5 151,02	
OIS/0.0/FIX/-0.351	EUR	20 015 790	-1 033,38	
OIS/0.0/FIX/-0.351	EUR	120 107 796	-8 378,36	
OIS/0.0/FIX/-0.351	EUR	124 377 277	-8 776,82	
OIS/0.0/FIX/-0.351	EUR	180 109 566	-11 167,61	
OIS/0.0/FIX/-0.351	EUR	225 696 021	-14 208,06	
OIS/0.0/FIX/-0.352	EUR	250 549 050	-14 194,52	
OIS/0.0/FIX/-0.352	EUR	321 846 097	-16 691,24	
OIS/0.0/FIX/-0.353	EUR	119 265 299	5 753,42	
OIS/0.0/FIX/-0.353	EUR	150 380 127	-6 416,80	
OIS/0.0/FIX/-0.354	EUR	195 355 547	9 902,74	
OIS/0.0/FIX/-0.358	EUR	145 269 474	5 685,74	
OIS/0.0/FIX/-0.358	EUR	60 053 130	3 065,94	
OIS/0.0/FIX/-0.359	EUR	40 020 454	-473,52	
TOTAL Swap de taux			-457 953,52	
TOTAL Autres instruments financiers à terme			-457 953,52	
TOTAL Instruments financiers à terme			-457 953,52	
Créances			522 859,64	
Dettes			-2 392 936,74	-0,02
Comptes financiers			30 718 832,88	0,25
Actif net			12 057 233 144,66	100,00



BFT INVESTMENT MANAGERS

Société Anonyme au capital de 1 600 000 euros

Société de Gestion de Portefeuille agréée par l'AMF n° GP 98 026

Siège social : 90, boulevard Pasteur 75015 Paris - France - 334 316 965 RCS Paris