



**INNOVER
POUR LA
PERFORMANCE**

90, BOULEVARD PASTEUR
CS 61595
75730 PARIS CEDEX 15

T 01 53 15 70 00

W WWW.CPR-AM.COM

CPR OBLIG 12 MOIS

OPCVM relevant de la Directive 2009/65/CE
FCP de droit français

RAPPORT SEMESTRIEL

EXERCICE CLOS LE 31 MARS 2022

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

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	1 359 716 067,24
b) Avoirs bancaires	208 815 761,23
c) Autres actifs détenus par l'OPC	200 445 379,25
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	1 768 977 207,72
e) Passif	-31 713 389,70
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	1 737 263 818,02

* 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
CPR OBLIG 12 MOIS I en EUR	C	1 502 156 809,64	14 273,087	105 244,00
CPR OBLIG 12 MOIS P en EUR	C	87 069 860,87	385 905,132	225,62
CPR Oblig 12 Mois R en EUR	C	396 311,27	4 028,132	98,38
CPR Oblig 12 Mois - S en EUR	C	147 640 836,24	148 611,944	993,46

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.	69,37	68,13
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.	8,90	8,74
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.	9,86	9,68

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

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

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

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	1 359 716 067,24	78,27	76,86
TOTAL		1 359 716 067,24	78,27	76,86

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

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

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

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	27,10	26,62
ESPAGNE	8,07	7,93
PAYS-BAS	7,75	7,61
ALLEMAGNE	6,16	6,05
ITALIE	5,27	5,17
ETATS-UNIS	4,35	4,27
IRLANDE	3,36	3,30
LUXEMBOURG	2,87	2,81
SUEDE	2,39	2,35
BELGIQUE	2,29	2,25
ROYAUME-UNI	1,93	1,90
JAPON	1,79	1,76
ISLANDE	0,99	0,97
PORTUGAL	0,92	0,91
FINLANDE	0,66	0,65
NORVEGE	0,60	0,58
CANADA	0,59	0,58
DANEMARK	0,54	0,53
ROUMANIE	0,40	0,40
AUSTRALIE	0,24	0,23
TOTAL	78,27	76,86

* 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	9,86	9,68
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 actifs		
Autres		
TOTAL	9,86	9,68

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

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

Mouvements dans le portefeuille titres en cours de période en EUR

Éléments 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.	310 814 489,76	318 710 204,58
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.	26 516 141,93	59 802 872,28
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.	112 249 016,50	107 255 667,10

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

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

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

a) Titres et matières premières prêtés

Montant					
% de l'Actif Net*					

*% 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			10 310 278,29		
% de l'Actif Net			0,59%		

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

--	--	--	--	--	--

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

BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA (MADRID) ESPAGNE			6 889 892,55		
CREDIT AGRICOLE CIB FRANCE			2 162 342,20		
HSBC FRANCE EX CCF FRANCE			1 258 043,54		

e) Type et qualité des garanties (collatéral)

Type					
- Actions					
- Obligations					
- OPC					
- TCN					
- Cash			10 319 761,85		
Rating					
Monnaie de la garantie					
Euro			10 319 761,85		

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

f) Règlement et compensation des contrats

Triparties				X	
Contrepartie centrale					
Bilatéraux	X			X	

g) Échéance de la garantie ventilée en fonction des tranches

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					

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

Moins d'1 jour					
1 jour à 1 semaine					
1 semaine à 1 mois			8 147 936,09		
1 à 3 mois			2 162 342,20		
3 mois à 1 an					
Plus d'1 an					
Ouvertes					

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					
Titres					
Cash					

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

k) Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC

Titres					
Cash					

l) Données sur les revenus et les coûts ventilés

Revenus					
- OPC			22 927,81		
- Gestionnaire					
- Tiers					
Coûts					
- OPC			15 622,23		
- Gestionnaire					
- Tiers					

e) Données Type et qualité des garanties (collatéral)

CPR 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.

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 la conservation des garanties fournies par l'OPC

CPR 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

Opérations de prêts de titres et de mise en pension :

Dans le cadre des opérations de prêts de titres et de mise en pension, CPR Asset Management, a confié à Amundi Intermédiation, pour le compte de l'OPC, 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 provenant des opérations de prêts de titres bénéficient à l'OPC, déduction faite des coûts opérationnels supportés par la société de gestion dans le cadre de la mise en place de ces opérations, lesquels coûts n'excéderont pas 40% des revenus générés par lesdites opérations.

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

Portefeuille titres détaillé au 31/03/2022 en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
ADLER REAL ESTATE AG 1.5% 17-04-22	EUR	7 200 000	7 252 873,99	0,42
CMZB FRANCFORT 0.25% 16-09-24	EUR	9 000 000	8 796 157,88	0,51
CMZB FRANCFORT 1.125% 24-05-24	EUR	2 500 000	2 526 290,34	0,14
CMZB FRANCFORT E3R+1.0% 24-11-23	EUR	4 700 000	4 760 444,63	0,28
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 1.625% 16-11-23	EUR	6 500 000	6 502 901,89	0,37
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 0.25% 17-01-25	EUR	6 300 000	6 153 864,64	0,35
EVONIK INDUSTRIES 1.0% 23-01-23 EMTN	EUR	2 000 000	2 015 217,89	0,11
LEG IMMOBILIEN SE 0.375% 17-01-26	EUR	4 500 000	4 301 707,19	0,25
SANTANDER CONSUMER BANK AG 0.75% 17-10-22	EUR	14 800 000	14 922 617,27	0,86
SCBGER 0 1/4 10/15/24	EUR	12 800 000	12 588 936,52	0,72
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 0.625% 01-04-22	EUR	4 100 000	4 125 554,79	0,24
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 1.5% 01-10-24	EUR	14 000 000	14 196 088,43	0,82
VOLKSWAGEN LEASING 0.5% 20-06-22	EUR	13 250 000	13 322 839,64	0,77
VONOVIA SE 0.0% 16-09-24 EMTN	EUR	1 500 000	1 461 023,06	0,09
VW 0 7/8 04/12/23	EUR	4 000 000	4 053 426,60	0,23
TOTAL ALLEMAGNE			106 979 944,76	6,16
AUSTRALIE				
AURI 2.0% 18-09-24 EMTN	EUR	4 000 000	4 146 708,35	0,24
TOTAL AUSTRALIE			4 146 708,35	0,24
BELGIQUE				
BELFIUS BANK 0.01% 15-10-25	EUR	1 600 000	1 541 531,82	0,09
BELFIUS BANK 0.625% 30-08-23	EUR	4 000 000	4 040 181,60	0,23
CCBGBB 1 10/26/24	EUR	12 000 000	12 077 338,11	0,70
KBC GROUPE 0.125% 10-09-26	EUR	8 000 000	7 662 267,37	0,44
KBC GROUPE 0.625% 10-04-25	EUR	9 600 000	9 529 255,36	0,55
KBC GROUPE 1.125% 25-01-24	EUR	4 800 000	4 870 337,40	0,28
TOTAL BELGIQUE			39 720 911,66	2,29
CANADA				
TORONTODOMINION BANK THE 0.375% 25-04-24	EUR	10 300 000	10 270 718,14	0,59
TOTAL CANADA			10 270 718,14	0,59
DANEMARK				
NYKRE 0 1/8 07/10/24	EUR	8 000 000	7 845 910,40	0,45
NYKREDIT 0.25% 20-01-23 EMTN	EUR	1 500 000	1 503 922,73	0,09
TOTAL DANEMARK			9 349 833,13	0,54
ESPAGNE				
AMADEUS CM 0.875% 18-09-23	EUR	4 000 000	4 044 390,82	0,24
BANCO NTANDER 1.125% 17-01-25	EUR	7 200 000	7 236 026,93	0,42
BANCO SANTANDER SA 0.25% 19-06-24	EUR	400 000	396 966,15	0,02
BANKIA 0.875% 25-03-24	EUR	7 000 000	7 007 767,24	0,40

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

Portefeuille titres détaillé au 31/03/2022 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BANKIA 1.0% 25-06-24 EMTN	EUR	10 700 000	10 796 249,34	0,63
BANKINTER 0.875% 05-03-24	EUR	12 200 000	12 255 311,84	0,71
BBVA 0.375% 02-10-24 EMTN	EUR	10 000 000	9 907 080,75	0,57
BBVA 1.375% 14-05-25 EMTN	EUR	10 000 000	10 228 022,46	0,59
CAIXABANK 0.375% 03-02-25 EMTN	EUR	11 200 000	10 974 358,89	0,63
CAIXABANK 0.625% 01-10-24 EMTN	EUR	14 100 000	13 953 148,15	0,80
CAIXABANK 2.375% 01-02-24 EMTN	EUR	7 000 000	7 240 902,99	0,41
CRITERIA CAIXAHOLDG 1.625% 21/04/22 EMTN	EUR	7 000 000	7 113 721,99	0,40
CRITERIA CAIXAHOLDING SAU 1.375% 10-04-24	EUR	7 500 000	7 682 881,48	0,44
CRITERIA CAIXAHOLDING SAU 1.5% 10-05-23	EUR	5 000 000	5 137 298,32	0,30
NT CONS FIN 1.0% 27-02-24 EMTN	EUR	3 900 000	3 929 022,09	0,23
NT CONS FIN AUTRE V 23-02-26	EUR	9 000 000	8 549 989,20	0,49
SABSM 1 5/8 03/07/24	EUR	8 000 000	8 088 222,43	0,46
SANT ISS 2.5% 18-03-25 EMTN	EUR	5 500 000	5 686 652,41	0,33
TOTAL ESPAGNE			140 228 013,48	8,07
ETATS-UNIS				
AT T 1.3% 05-09-23	EUR	12 000 000	12 249 672,03	0,71
BALL 0.875% 15-03-24	EUR	3 500 000	3 487 206,39	0,20
BALL 4.375% 15-12-23	EUR	1 200 000	1 281 749,95	0,07
BECTON DICKINSON AND 0.0% 13-08-23	EUR	900 000	894 404,98	0,05
BOOKING 0.1% 08-03-25	EUR	6 100 000	5 939 236,96	0,34
FIDELITY NATL INFORMATION SCES 0.75% 21-05-23	EUR	8 780 000	8 886 091,06	0,51
GENERAL MOTORS FINANCIAL 0.2% 02-09-22	EUR	8 800 000	8 817 008,68	0,51
GEN MILLS 1.0% 27-04-23	EUR	4 000 000	4 063 502,34	0,23
MORGAN STANLEY CAPITAL SERVICE 0.637% 26-07-24	EUR	5 000 000	5 040 696,50	0,29
MORGAN STANLEY CAPITAL SERVICE 1.0% 02-12-22	EUR	5 300 000	5 361 871,21	0,31
MORG STAN CAP 1.75% 11-03-24	EUR	11 200 000	11 440 920,33	0,66
T 1.45 06/01/22	EUR	8 000 000	8 107 368,53	0,47
TOTAL ETATS-UNIS			75 569 728,96	4,35
FINLANDE				
NOKIA 2 03/15/24	EUR	4 000 000	4 076 584,93	0,23
OP CORPORATE BANK 0.375% 19-06-24	EUR	7 500 000	7 438 467,69	0,44
TOTAL FINLANDE			11 515 052,62	0,67
FRANCE				
ACCOR 2.5% 25-01-24	EUR	2 900 000	2 958 652,08	0,17
ALD 0.0% 23-02-24 EMTN	EUR	9 700 000	9 551 779,73	0,55
ALD 0.375% 18-07-23 EMTN	EUR	7 000 000	7 022 461,72	0,40
ALD 0.375% 19-10-23 EMTN	EUR	5 000 000	4 998 837,39	0,29
ARVAL SERVICE LEASE 0.875% 17-02-25	EUR	4 800 000	4 781 033,47	0,28
ATOS SE 0.75% 07-05-22	EUR	8 300 000	8 354 478,84	0,48
BFCM(BQUE FEDER.CREDIT M 3.0% 21/05/2024	EUR	10 825 000	11 590 060,65	0,67
BFCM 1.625% 19-01-26 EMTN	EUR	12 000 000	12 222 191,75	0,70
BFCM BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL 0.01% 11-05-26	EUR	14 500 000	13 767 591,78	0,80

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

Portefeuille titres détaillé au 31/03/2022 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BFCM BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL 0.75% 08-06-26	EUR	10 000 000	9 863 592,62	0,56
BNP PA 0.75% 11-11-22 EMTN	EUR	4 000 000	4 037 434,09	0,23
BNP PAR 0.5% 04-06-26	EUR	5 400 000	5 275 529,45	0,30
BNP PAR 1.125% 11-06-26 EMTN	EUR	10 500 000	10 503 446,96	0,60
BNP PAR 1.125% 22-11-23 EMTN	EUR	7 400 000	7 517 325,06	0,43
BNP PAR 1.125% 28-08-24	EUR	10 000 000	10 119 613,42	0,58
BNP PAR 1.5% 17-11-25 EMTN	EUR	10 700 000	10 836 248,55	0,62
BNP PAR E3R+0.62% 22-05-23	EUR	6 000 000	6 028 821,09	0,35
BNP PARIBAS 0.5% 15-07-25 EMTN	EUR	5 000 000	4 958 316,63	0,28
BPCE 0.01% 14-01-27	EUR	2 200 000	2 071 036,51	0,12
BPCE 0.25% 15-01-26	EUR	15 000 000	14 553 066,43	0,84
BPCE 0.375% 02-02-26 EMTN	EUR	7 800 000	7 593 814,46	0,43
BPCE 0.625% 26-09-23 EMTN	EUR	2 800 000	2 824 002,70	0,16
BPCE 0.625% 26-09-24 EMTN	EUR	14 600 000	14 560 217,36	0,84
BPCE 1.0% 01-04-25 EMTN	EUR	15 900 000	15 982 081,73	0,92
BPCE 1.0% 15-07-24	EUR	9 200 000	9 341 407,96	0,53
BQ POSTALE 1.0% 16-10-24 EMTN	EUR	15 000 000	15 063 554,78	0,87
CARMILA SAS 2.375% 16-09-24	EUR	7 900 000	8 205 431,34	0,47
CARMILA SAS 2.375% 18-09-23	EUR	4 000 000	4 133 909,15	0,24
CARREFOUR 0.875% 12-06-23 EMTN	EUR	4 000 000	4 047 683,20	0,23
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN 0.625% 15-03-24	EUR	2 000 000	1 996 583,41	0,12
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN 1.75% 03-04-23	EUR	4 500 000	4 641 477,00	0,27
ELIS EX HOLDELIS 1.75% 11-04-24	EUR	5 500 000	5 626 359,11	0,32
ESSILORLUXOTTICA 0.0% 27-05-23	EUR	17 200 000	17 199 308,73	0,99
FRFP 3 1/4 01/22/24	EUR	4 600 000	4 781 717,04	0,28
KERING 0.25% 13-05-23 EMTN	EUR	15 600 000	15 672 338,13	0,90
LAGARDERE 2.75% 13-04-23	EUR	2 700 000	2 808 477,68	0,17
L OREAL S A E3R+0.7% 29-03-24	EUR	7 200 000	7 284 686,25	0,42
LVMH MOET HENNESSY 0.125% 28-02-23	EUR	8 000 000	8 024 257,32	0,47
NEXANS 3.75% 08-08-23	EUR	4 500 000	4 758 210,88	0,27
ORANO SA 3.125% 20-03-23 EMTN	EUR	8 300 000	8 449 444,74	0,49
PERNOD RICARD ZCP 24-10-23	EUR	9 000 000	8 954 788,23	0,52
PSA BANQUE FRANCE 0.5% 12-04-22	EUR	11 000 000	11 054 796,24	0,64
PSA BANQUE FRANCE 0.625% 21-06-24	EUR	12 370 000	12 341 259,18	0,71
PSA BANQUE FRANCE 0.75% 19-04-23	EUR	5 600 000	5 667 526,75	0,33
RENAULT 1.0% 18-04-24 EMTN	EUR	6 000 000	5 859 084,18	0,34
RENAULT CREDIT INTL BANQUE 0.75% 10-04-23	EUR	3 500 000	3 527 772,33	0,21
RENAULT CREDIT INTL BANQUE 1.375% 08-03-24	EUR	5 000 000	5 003 171,49	0,28
SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.0000010% 12-06-23	EUR	6 600 000	6 593 944,50	0,38
SG 0.5% 13-01-23 EMTN	EUR	10 000 000	10 071 165,15	0,58
SG 1.125% 23-01-25 EMTN	EUR	21 000 000	21 141 771,18	1,22
SG 1.25% 15-02-24 EMTN	EUR	19 700 000	19 921 336,78	1,14
SODEXO 0.5% 17-01-24	EUR	5 700 000	5 706 049,64	0,32

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

Portefeuille titres détaillé au 31/03/2022 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
UBISOFT 1.289% 30-01-23	EUR	8 500 000	8 535 385,19	0,49
VIVENDI 0.0% 13-06-22 EMTN	EUR	8 700 000	8 701 381,13	0,50
WORLDLINE 0.25% 18-09-24	EUR	14 000 000	13 781 456,04	0,80
TOTAL FRANCE			470 867 369,20	27,10
IRLANDE				
BK IRELAND GROUP 0.75% 08-07-24	EUR	3 100 000	3 118 745,25	0,18
BK IRELAND GROUP 1.375% 29-08-23	EUR	9 500 000	9 689 430,70	0,56
DELL BANK INTL DAC 1.625% 24-06-24	EUR	3 000 000	3 071 814,64	0,17
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 0.0% 16-04-24	EUR	8 000 000	7 854 483,92	0,45
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 0.25% 28-02-23	EUR	12 400 000	12 429 694,14	0,72
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 0.5% 13-09-24	EUR	16 300 000	16 162 761,78	0,93
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 0.625% 24-11-22	EUR	5 960 000	5 998 200,96	0,35
TOTAL IRLANDE			58 325 131,39	3,36
ISLANDE				
ISLANDSBANKI HF 0.5% 20-11-23	EUR	6 400 000	6 368 846,60	0,37
ISLANDSBANKI HF 0.75% 25-03-25	EUR	6 000 000	5 827 478,68	0,33
LANDSBANKINN HF 1.0% 30-05-23	EUR	5 000 000	5 048 638,47	0,29
TOTAL ISLANDE			17 244 963,75	0,99
ITALIE				
AUTO PER L IT 1.625% 12-06-23	EUR	2 000 000	2 041 357,50	0,12
BANCO BPM 1.75% 24-04-23 EMTN	EUR	1 889 000	1 943 835,83	0,11
BANCO BPM 2.5% 21-06-24 EMTN	EUR	3 000 000	3 121 902,54	0,18
IGIM 0 1/4 06/24/25	EUR	3 000 000	2 909 603,69	0,16
INTE 0.75% 04-12-24 EMTN	EUR	16 690 000	16 641 676,94	0,96
INTE 1.0% 04-07-24 EMTN	EUR	19 010 000	19 191 487,52	1,11
INTE 1.375% 18-01-24 EMTN	EUR	16 000 000	16 289 532,46	0,94
MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ 0.625% 27-09-22	EUR	7 000 000	7 048 909,41	0,41
MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ 1.625% 07-01-25	EUR	6 625 000	6 733 914,04	0,38
MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ E3R+0.8% 18-05-22	EUR	5 000 000	5 004 917,27	0,29
UNICREDIT 1.0% 18-01-23 EMTN	EUR	10 500 000	10 595 319,13	0,61
TOTAL ITALIE			91 522 456,33	5,27
JAPON				
ASAHI BREWERIES 0.01% 19-04-24	EUR	3 900 000	3 841 903,75	0,23
MIZUHO FINANCIAL GROUP 0.184% 13-04-26	EUR	13 000 000	12 389 111,89	0,71
MIZUHO FINANCIAL GROUP 0.214% 07-10-25	EUR	10 071 000	9 718 670,87	0,56
NISSAN MOTOR 1.94% 15-09-23	EUR	5 000 000	5 119 831,52	0,29
TOTAL JAPON			31 069 518,03	1,79
LUXEMBOURG				
ARCELLOR MITTAL 1.0% 19-05-23	EUR	6 210 000	6 297 416,46	0,36
BANQUE 1 1/2 09/28/23	EUR	11 400 000	11 614 123,96	0,67
BECTON DICKINSON EURO FINANCE SARL 0.632% 04-06-23	EUR	13 850 000	13 986 780,67	0,80
HIGHLAND HOLDINGS SARL 0.0000010% 12-11-23	EUR	3 500 000	3 466 057,14	0,20
MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.0% 15-03-23	EUR	8 700 000	8 708 302,15	0,50

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

Portefeuille titres détaillé au 31/03/2022 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SIG COMBIBLOC PURCHASER 1.875% 18-06-23	EUR	2 700 000	2 735 836,80	0,16
SIMO INTE FIN 1.375% 18-11-22	EUR	2 935 000	2 967 186,45	0,17
TOTAL LUXEMBOURG			49 775 703,63	2,86
NORVEGE				
DNB BANK A 0.05% 14-11-23 EMTN	EUR	10 400 000	10 347 068,28	0,60
TOTAL NORVEGE			10 347 068,28	0,60
PAYS-BAS				
ANNGR 2 1/4 12/15/23	EUR	4 000 000	4 142 450,35	0,23
CITY TREA BV 2.5% 01-10-24	EUR	4 000 000	4 105 193,88	0,24
DEUT TEL 0.625% 03-04-23 EMTN	EUR	8 275 000	8 380 130,81	0,49
DIGITAL DUTCH FINCO BV E3R+0.48% 23-09-22	EUR	7 900 000	7 906 419,22	0,45
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV ZCP 17-06-24	EUR	14 960 000	14 703 926,99	0,84
HEIMSTADEN BOSTAD AB 2.125% 05-09-23	EUR	5 165 000	5 327 005,29	0,31
HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 0.25% 13-10-24	EUR	4 900 000	4 765 065,24	0,27
IBER INT 1.125% 27-01-23 EMTN	EUR	6 100 000	6 174 550,73	0,36
ING GROEP NV 0.1% 03-09-25	EUR	7 000 000	6 830 406,96	0,39
ING GROEP NV 1.125% 14-02-25	EUR	6 000 000	6 027 797,92	0,35
ING GROEP NV 2.125% 10-01-26	EUR	6 500 000	6 724 703,86	0,39
LEASEPLAN CORPORATION NV 0.125% 13-09-23	EUR	7 100 000	7 050 151,52	0,41
LEASEPLAN CORPORATION NV 1.0% 02-05-23	EUR	1 000 000	1 015 813,47	0,06
LSEG NETHERLANDS BV 0.0% 06-04-25	EUR	3 700 000	3 603 410,83	0,20
RDSALN 0 1/2 05/11/24	EUR	3 300 000	3 310 180,72	0,19
RELX FINANCE BV 0.0% 18-03-24	EUR	2 000 000	1 976 176,02	0,11
REPSM 0 1/2 05/23/22	EUR	3 500 000	3 518 118,39	0,21
REPSOL INTL FINANCE BV 0.125% 05-10-24	EUR	10 400 000	10 242 386,59	0,59
SCHLUMBERGER FINANCE BV 0.0% 15-10-24	EUR	10 870 000	10 667 951,05	0,61
STELLANTIS NV 3.75% 29-03-24	EUR	9 000 000	9 476 504,91	0,55
VONOVIA FINANCE BV 0.125% 06-04-23	EUR	8 700 000	8 710 581,31	0,50
TOTAL PAYS-BAS			134 658 926,06	7,75
PORTUGAL				
GALP ENERGIA 1.0% 15-02-23	EUR	15 900 000	16 014 473,15	0,92
TOTAL PORTUGAL			16 014 473,15	0,92
ROUMANIE				
UNICREDIT LEASING CORP IFN SA 0.502% 18-10-22	EUR	7 000 000	7 034 990,56	0,40
TOTAL ROUMANIE			7 034 990,56	0,40
ROYAUME-UNI				
EAS 1.75% 09-02-23 EMTN	EUR	5 800 000	5 866 083,69	0,34
EASYJET 1.125% 18-10-23 EMTN	EUR	6 000 000	6 082 596,03	0,35
GSK CAP 0.125% 12-05-23 EMTN	EUR	3 600 000	3 609 721,06	0,21
HSBC 1.5% 04-12-24 EMTN	EUR	1 000 000	1 018 992,32	0,06
LLOYDS BANKING GROUP 0.625% 15-01-24	EUR	4 500 000	4 528 616,79	0,26
LLOYDS BANKING GROUP 3.5% 01-04-26	EUR	6 218 000	6 801 913,29	0,39
SANTANDER UK GROUP 0.391% 28-02-25	EUR	5 700 000	5 629 977,11	0,32

Portefeuille titres détaillé au 31/03/2022 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TOTAL ROYAUME-UNI			33 537 900,29	1,93
SUEDE				
AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY 1.75% 07-02-25	EUR	5 000 000	5 053 291,80	0,29
SCANIA CV AB 0.5% 06-10-23	EUR	5 641 000	5 645 347,79	0,32
SECURITAS AB 1.125% 20-02-24	EUR	12 030 000	12 050 337,61	0,69
SHBASS 0 1/8 11/03/26	EUR	13 300 000	12 674 989,77	0,73
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 0.25% 19-05-23	EUR	3 000 000	3 013 060,96	0,18
VLVY 0 02/11/23	EUR	3 100 000	3 099 627,54	0,18
TOTAL SUEDE			41 536 655,47	2,39
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			1 359 716 067,24	78,27
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			1 359 716 067,24	78,27
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
CPR MONETAIRE ISR - Z	EUR	3 900	77 842 128,00	4,48
CPR Oblig 6 Mois I	EUR	945	93 463 807,50	5,38
TOTAL FRANCE			171 305 935,50	9,86
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			171 305 935,50	9,86
TOTAL Organismes de placement collectif			171 305 935,50	9,86
Titres donnés en pension				
ESPAGNE				
BANKIA 0.875% 25-03-24	EUR	2 000 000	2 002 219,21	0,12
NT CONS FIN AUTRE V 23-02-26	EUR	1 000 000	949 998,80	0,05
TOTAL ESPAGNE			2 952 218,01	0,17
FRANCE				
BFCM(BQUE FEDER.CREDIT M 3.0% 21/05/2024	EUR	1 175 000	1 258 043,54	0,07
BNP PAR 0.5% 04-06-26	EUR	2 600 000	2 540 069,74	0,15
TOTAL FRANCE			3 798 113,28	0,22
ITALIE				
MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ 1.625% 07-01-25	EUR	1 375 000	1 397 604,80	0,08
TOTAL ITALIE			1 397 604,80	0,08
PAYS-BAS				
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV ZCP 17-06-24	EUR	2 200 000	2 162 342,20	0,12
TOTAL PAYS-BAS			2 162 342,20	0,12
TOTAL Titres donnés en pension			10 310 278,29	0,59
Dettes représentatives des titres données en pension			-10 321 132,50	-0,59
Indemnités sur titres données en pension			1 370,65	
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
EURO BOBL 0622	EUR	-1 159	4 913 230,00	0,28
EURO SCHATZ 0622	EUR	-641	740 355,00	0,05

OPCVM CPR OBLIG 12 MOIS

Portefeuille titres détaillé au 31/03/2022 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			5 653 585,00	0,33
TOTAL Engagements à terme fermes			5 653 585,00	0,33
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				
E6M/0.0/FIX/0.155	EUR	50 000 000	-212 587,50	-0,01
E6R/0.0/FIX/0.1795	EUR	30 000 000	-175 420,59	-0,01
E6R/0.0/FIX/0.203	EUR	20 000 000	-125 287,34	
E6R/0.0/FIX/-0.304	EUR	10 500 000	471 866,12	0,02
E6R/0.0/FIX/-0.335	EUR	12 000 000	360 033,67	0,02
E6R/0.0/FIX/-0.402	EUR	80 000 000	429 179,11	0,02
E6R/0.0/FIX/-0.424	EUR	12 000 000	294 227,80	0,01
E6R/0.0/FIX/-0.428	EUR	65 000 000	1 096 664,48	0,07
E6R/0.0/FIX/-0.441	EUR	60 000 000	791 147,00	0,04
E6R/0.0/FIX/-0.446	EUR	16 000 000	489 862,22	0,03
E6R/0.0/FIX/-0.451	EUR	45 000 000	862 460,50	0,05
E6R/0.0/FIX/-0.458	EUR	37 000 000	1 843 644,33	0,10
E6R/0.0/FIX/-0.467	EUR	20 000 000	472 121,95	0,03
E6R/0.0/FIX/-0.476	EUR	125 000 000	3 672 984,03	0,21
E6R/0.0/FIX/-0.493	EUR	70 000 000	277 635,75	0,02
TOTAL Swaps de taux			10 548 531,53	0,60
TOTAL Autres instruments financiers à terme			10 548 531,53	0,60
TOTAL Instrument financier à terme			16 202 116,53	0,93
Appel de marge				
APPEL MARGE CACEIS	EUR	-5 653 585	-5 653 585,00	-0,32
TOTAL Appel de marge			-5 653 585,00	-0,32
Créances			2 113 753,50	0,12
Dettes			-15 226 747,15	-0,88
Comptes financiers			208 815 760,96	12,02
Actif net			1 737 263 818,02	100,00