

FCP de droit français

**Edmond de Rothschild
Credit Very Short Term**

RAPPORT SEMESTRIEL

au 30 juin 2023

Société de gestion : Edmond De Rothschild Asset Management (France)

Dépositaire : Caceis Bank

Commissaire aux comptes : KPMG Audit

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	829 627 999,58
b) Avoirs bancaires	164 618 100,27
c) Autres actifs détenus par l'OPC	152 988 936,05
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	1 147 235 035,90
e) Passif	-18 298 835,72
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	1 128 936 200,18

* 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
Edmond de Rothschild Credit Very Short Term BH en USD	C	16 969 199,52	153 207,262	110,759
Edmond de Rothschild Credit Very Short Term C en EUR	C	918 553 550,56	7 284 394,331	126,098
Edmond de Rothschild Credit Very Short Term D en EUR	D	4 543 048,74	31 235,997	145,442
Edmond de Rothschild Credit Very Short Term R en EUR	C/D	190 285 797,47	1 902	100 045,109

ELEMENT DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
<p>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.</p> <p>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.</p>	55,80	54,91
<p>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.</p>	17,69	17,41
<p>D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.</p>		
<p>E) Les autres actifs.</p>	4,41	4,34

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

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

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Euro	EUR	829 627 999,58	73,49	72,32
TOTAL		829 627 999,58	73,49	72,32

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

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

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RESIDENCE DE L'EMETTEUR

Pays	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
FRANCE	23,59	23,22
ROYAUME-UNI	11,49	11,31
PAYS-BAS	9,93	9,77
SUEDE	5,76	5,67
ETATS-UNIS	5,13	5,05
ITALIE	4,40	4,33
LUXEMBOURG	3,44	3,38
FINLANDE	2,84	2,80
BELGIQUE	2,19	2,16
IRLANDE	1,18	1,16
ALLEMAGNE	1,11	1,09
ESPAGNE	1,09	1,07
NORVEGE	0,88	0,87
CANADA	0,45	0,44
TOTAL	73,49	72,32

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

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

REPARTITION 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	4,41	4,34
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	4,41	4,34

* 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 PERIODE 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.	1 398 061 353,11	1 136 322 545,33
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.	723 270 023,20	634 500 000,00
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.	14 999 667,84	16 038 274,42

DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE

	Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
Dividendes versés				
	Edmond de Rothschild Credit Very Short Term D			
	Edmond de Rothschild Credit Very Short Term R			
Dividendes à verser				
	Edmond de Rothschild Credit Very Short Term D			
	Edmond de Rothschild Credit Very Short Term R			

INFORMATIONS DIVERSES

Etablissement dépositaire : Caceis Bank - 12 place des États-Unis - CS 40083 - 92549 - Montrouge Cedex
Le relevé Périodicité Semestrielle détaillé de l'actif est disponible dans un délai de huit semaines à compter de la fin de la période. Il peut être transmis sur simple demande auprès de la société de gestion :

Edmond De Rothschild Asset Management (France) - 47 rue du Faubourg Saint-Honoré - 75401 - Paris Cedex 08

SECURITIES FINANCING TRANSACTION REGULATION (REGLEMENT RELATIF AUX OPERATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES) (« SFTR »)

Au cours de l'exercice, l'OPC n'est pas intervenu sur des opérations soumises au Règlement UE 2015/2365 relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation (« Règlement SFTR »).

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Dépôts				
DAT +3.42 COFIFRPP	EUR	5 000 000	5 083 600,00	0,45
DAT BRED E0.18 70823	EUR	10 000 000	10 121 330,28	0,90
DAT CMARKEA ETR+0.27	EUR	2 000 000	2 032 540,89	0,18
DAT CO 3.95 150524	EUR	10 000 000	10 049 375,00	0,89
DAT COFI +4.1 100624	EUR	10 000 000	10 021 638,89	0,89
DAT COFI 3.55 020224	EUR	8 000 000	8 116 755,56	0,72
DAT COFI 3.55 310123	EUR	5 000 000	5 074 451,39	0,45
DAT COFIF 3.7 100424	EUR	10 000 000	10 083 250,00	0,89
DAT COFIFR +3.75	EUR	7 000 000	7 078 750,00	0,63
DAT COFIFR 2.75	EUR	7 000 000	7 139 562,50	0,63
DAT COFIFR 3.05	EUR	7 000 000	7 125 134,72	0,63
DAT COFIFRPP 2.8	EUR	3 000 000	3 057 866,67	0,27
TOTAL Dépôts			84 984 255,90	7,53
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG E3R+0.7% 10-04-24	EUR	2 000 000	2 019 848,33	0,18
TOTAL ALLEMAGNE			2 019 848,33	0,18
CANADA				
Bank of Montreal E3R+0.45% 06-06-25	EUR	3 520 000	3 535 310,40	0,32
TORONTO DOMINION BANK THE E3R+0.45% 20-01-25	EUR	1 500 000	1 515 220,90	0,13
TOTAL CANADA			5 050 531,30	0,45
ESPAGNE				
BANCO NTANDER E3R+0.55% 16-01-25	EUR	1 500 000	1 515 331,45	0,13
TOTAL ESPAGNE			1 515 331,45	0,13
ETATS-UNIS				
ATT E3R+0.4% 06-03-25	EUR	2 000 000	2 008 592,31	0,18
EATON CAPITAL UN E3R+0.25% 03-06-24	EUR	2 000 000	2 005 960,44	0,18
GEN MILLS E3R+0.29% 27-07-23	EUR	2 000 000	2 013 581,33	0,17
TOTAL ETATS-UNIS			6 028 134,08	0,53
FRANCE				
ALD E3R+0.55% 21-02-25 EMTN	EUR	700 000	704 813,94	0,06
ALD E3R+0.55% 21-02-25 EMTN	EUR	2 000 000	2 011 455,50	0,18
BNP PAR E3R+0.3% 24-02-25 EMTN	EUR	3 000 000	3 014 962,67	0,27
CA E3R+0.32% 07-03-25 EMTN	EUR	1 400 000	1 404 472,37	0,12
TOTAL FRANCE			7 135 704,48	0,63
LUXEMBOURG				
TRATON FINANCE LUXEMBOURG E3R+0.75% 27-08-23	EUR	1 000 000	1 004 702,00	0,09
TOTAL LUXEMBOURG			1 004 702,00	0,09
PAYS-BAS				
THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE I BV E3R+0.2% 18-11-23	EUR	2 000 000	2 008 828,80	0,18
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0.33% 29-11-24	EUR	2 000 000	2 007 152,33	0,18
TOTAL PAYS-BAS			4 015 981,13	0,36

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SUEDE				
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB E3R+0.45% 13-06-25	EUR	2 100 000	2 105 108,84	0,20
VOLVO TREASURY AB E3R+0.75% 11-01-24	EUR	600 000	606 694,64	0,05
VOLVO TREASURY AB E3R+0.75% 13-09-23	EUR	900 000	902 961,98	0,08
TOTAL SUEDE			3 614 765,46	0,33
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			30 384 998,23	2,70
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			30 384 998,23	2,70
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
CONTINENTAL AG 170723 FIX 3.51	EUR	10 500 000	10 482 473,69	0,93
TOTAL ALLEMAGNE			10 482 473,69	0,93
BELGIQUE				
BNP PARIBAS FORTIS SA 081123 FIX 3.35	EUR	5 000 000	4 931 539,80	0,44
BNP PARIBAS FORTIS SA 120224 FIX 3.749	EUR	5 000 000	4 876 795,67	0,43
KBC BANK NV 260723 FIX 3.35	EUR	5 000 000	4 987 830,24	0,44
SUMITOMO MITSUI 260723 FIX 3.47	EUR	10 000 000	9 974 836,90	0,88
TOTAL BELGIQUE			24 771 002,61	2,19
ESPAGNE				
BANCO SANTANDER SA 040723 FIX 3.26	EUR	5 000 000	4 998 092,45	0,44
BANCO SANTANDER SA 300424 FIX 3.88	EUR	6 000 000	5 796 078,89	0,52
TOTAL ESPAGNE			10 794 171,34	0,96
ETATS-UNIS				
FIDELITY NATION 310723 FIX 3.55	EUR	22 500 000	22 430 510,15	1,99
FISERV INC 030823 FIX 3.44	EUR	1 500 000	1 495 135,50	0,13
FISERV INC 200723 FIX 3.36	EUR	1 500 000	1 497 120,74	0,13
STANLEY BLACK DECKER INC 180723 FIX 3.5	EUR	5 000 000	4 991 226,24	0,44
TOTAL ETATS-UNIS			30 413 992,63	2,69
FINLANDE				
NORD B OIEST+0.2% 13-10-23	EUR	10 000 000	10 073 169,58	0,89
NORDEA BANK ABP. 160224 OIEST 0.25	EUR	3 000 000	3 035 130,26	0,27
NORDEA BANK ABP. 221123 OIEST 0.18	EUR	5 000 000	5 018 240,91	0,44
NORDEA BKP ZCP 24-07-23	EUR	10 000 000	9 976 984,65	0,88
OP CORPORATE BANK PLC 280923 FIX 2.6	EUR	3 000 000	2 972 662,15	0,27
TOTAL FINLANDE			31 076 187,55	2,75
FRANCE				
AIR LIQUIDE FINANCE 170723 FIX 3.245	EUR	3 000 000	2 995 186,35	0,27
ALSTOM SA 290823 FIX 3.62	EUR	10 000 000	9 939 196,70	0,88
ANTALIS ZCP 14-08-23	EUR	10 000 000	9 955 495,72	0,88
ARVA SERV LEAS ZCP 13-07-23	EUR	5 000 000	4 993 623,08	0,44
BFCM (BANQUE FEDE 031023 OIEST 0.2	EUR	4 000 000	4 033 051,10	0,36
BFCM (BANQUE FEDE 070823 OIEST 0.2	EUR	5 000 000	5 090 421,25	0,45
BFCM (BANQUE FEDER 080324 OIEST 0.32	EUR	7 000 000	7 045 947,84	0,63
BFCM (BANQUE FEDER 081223 OIEST 0.34	EUR	3 000 000	3 051 099,49	0,27
BFCM (BANQUE FEDER 090524 OIEST 0.31	EUR	5 000 000	5 010 799,05	0,45
BFCM (BANQUE FEDER 110424 OIEST 0.35	EUR	5 000 000	5 040 499,65	0,45
BFCM B OIEST+0.23% 03-10-23	EUR	5 000 000	5 092 578,91	0,45

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BNP PARIBAS 031123 OISEST 0.21	EUR	2 000 000	2 025 381,20	0,18
BNP PARIBAS 101023 OISEST 0.22	EUR	10 000 000	10 142 113,78	0,90
BNP PARIBAS 190324 OISEST 0.22	EUR	5 000 000	5 004 717,66	0,44
BPCE SA 060324 OISEST 0.32	EUR	4 000 000	4 043 436,55	0,36
BPCE SA 071123 OISEST 0.27	EUR	5 000 000	5 089 326,64	0,45
BPCE SA 131123 OISEST 0.29	EUR	5 000 000	5 072 717,84	0,45
CREDIT AGRICOLE SA 040624 OISEST 0.36	EUR	5 000 000	5 012 027,71	0,44
CREDIT AGRICOLE SA 110124 OISEST 0.27	EUR	10 000 000	10 075 487,47	0,90
CREDIT AGRICOLE SA 130324 OISEST 0.32	EUR	3 000 000	3 030 028,36	0,26
CREDIT AGRICOLE SA 150923 OISEST 0.28	EUR	10 000 000	10 193 730,98	0,90
CREDIT AGRICOLE SA 160524 OISEST 0.35	EUR	5 000 000	5 021 278,15	0,44
CREDIT INDUSTRIEL ET COMMERCIAL 040324 O	EUR	5 000 000	5 023 805,75	0,45
CREDIT LYONNAIS 021123 OISEST 0.19	EUR	3 000 000	3 016 495,41	0,27
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 050723 FIX 3.355	EUR	5 000 000	4 997 559,29	0,44
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 130723 FIX 3.4	EUR	10 000 000	9 987 467,73	0,88
ENGIE SA 060723 OISEST 0.14	EUR	20 000 000	20 152 511,36	1,79
ENGIE SA 240723 OISEST 1.0E-9	EUR	10 000 000	10 006 511,67	0,89
ICADE SA 250823 FIX 3.4	EUR	5 000 000	4 972 369,91	0,44
NATIXIS 110424 OISEST 0.33	EUR	3 000 000	3 023 247,20	0,27
NATIXIS 131223 OISEST 0.32	EUR	3 000 000	3 044 262,56	0,27
RTE EDF TRANSPORT 200723 FIX 3.46	EUR	10 000 000	9 980 644,44	0,88
SCHNEIDER ELECTRIC SE 210723 FIX 3.315	EUR	7 000 000	6 985 673,20	0,62
SCHNEIDER ELECTRIC SE 290923 FIX 3.665	EUR	7 800 000	7 728 483,21	0,69
SOCIETE GENERALE SA 020424 OISEST 0.34	EUR	10 000 000	10 076 886,15	0,89
SOCIETE GENERALE SA 080324 OISEST 0.38	EUR	10 000 000	10 116 545,63	0,89
SOCIETE GENERALE SA 310724 OISEST 0.4	EUR	10 000 000	10 003 166,44	0,88
SOCIETE GENERALE SA 311023 OISEST 0.25	EUR	10 000 000	10 131 115,02	0,90
UNION FINANCES GRAINS (UFG) 170723 FIX 3	EUR	3 000 000	2 995 006,60	0,26
TOTAL FRANCE			259 199 897,05	22,96
IRLANDE				
BANK OF AMERICA EUROPE DAC 201123 FIX 3.635	EUR	6 500 000	6 402 600,30	0,56
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 110923	EUR	2 000 000	1 985 201,62	0,18
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 120124 FIX 3.83	EUR	5 000 000	4 892 401,88	0,44
TOTAL IRLANDE			13 280 203,80	1,18
ITALIE				
SNAM SPA 170723 FIX 3.56	EUR	20 000 000	19 966 272,04	1,77
UNICREDIT SPA 080923 FIX 3.555	EUR	5 000 000	4 964 813,94	0,44
UNICREDIT SPA-LONDON BRANCH 100823 FIX 3.21	EUR	5 000 000	4 980 007,78	0,44
TOTAL ITALIE			29 911 093,76	2,65
LUXEMBOURG				
INTESA SANPAOLO 100723 FIX 3.105	EUR	10 000 000	9 990 433,96	0,88
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 11092	EUR	8 000 000	7 940 806,48	0,71
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 140923 FIX 3.67	EUR	5 000 000	4 961 398,41	0,44
MEDIOBANCA INTERNATIONAL (LUX) 311023 FI	EUR	5 000 000	4 936 946,48	0,44
REPSOL EUROPE FINANCE SARL 130723 FIX 3.	EUR	10 000 000	9 987 525,73	0,88
TOTAL LUXEMBOURG			37 817 111,06	3,35
NORVEGE				
DNB BANK ASA 020823 FIX 1.05	EUR	10 000 000	9 968 723,76	0,88
TOTAL NORVEGE			9 968 723,76	0,88

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
PAYS-BAS				
AKZO NOBEL NV 080823 FIX 3.39	EUR	10 000 000	9 961 626,06	0,88
AKZO NOBEL NV 110723 FIX 3.255	EUR	5 000 000	4 994 515,52	0,44
AKZO NOBEL NV 150823 FIX 3.39	EUR	10 000 000	9 954 941,96	0,88
AMERICA MOVIL SAB DE CV 070723 FIX 3.41	EUR	5 000 000	4 996 492,16	0,44
AVERY DENNISON 210823 FIX 3.63	EUR	10 000 000	9 947 770,90	0,88
COCA COLA HBC FINANCE BV 280723 FIX 3.42	EUR	6 000 000	5 983 758,09	0,53
HEINEKEN NV 030823 FIX 3.52	EUR	10 000 000	9 966 855,06	0,88
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 120923 FIX 3.	EUR	10 000 000	9 925 054,56	0,88
ING BANK N.V. 100524 OISEST 0.31	EUR	3 000 000	3 015 938,71	0,27
ING BANK N.V. 230424 OISEST 0.3	EUR	6 000 000	6 041 006,13	0,53
ING BANK N.V. 260124 FIX 3.365	EUR	5 000 000	4 887 074,64	0,44
ING BANK N.V. 310524 OISEST 0.39	EUR	5 000 000	5 019 332,95	0,45
ING BANK NV ZCP 01-12-23	EUR	2 000 000	1 967 530,22	0,17
LINDE FINANCE BV 180723 FIX 3.37	EUR	3 500 000	3 494 051,60	0,31
LSEG NETH BV ZCP 19-07-23	EUR	15 000 000	14 972 180,95	1,33
TOTAL PAYS-BAS			105 128 129,51	9,31
ROYAUME-UNI				
AMCOR UK FINANCE PLC 030723 FIX 3.56	EUR	12 500 000	12 496 243,14	1,11
AMCOR UK FINANCE PLC 120723 FIX 3.52	EUR	3 000 000	2 996 381,21	0,27
AMCOR UK FINANCE PLC 190723 FIX 3.58	EUR	8 000 000	7 984 731,18	0,71
AMCOR UK FINANCE PLC 200723 FIX 3.59	EUR	5 000 000	4 989 955,06	0,44
BARC B OISEST+0.22% 30-10-23	EUR	5 000 000	5 022 352,40	0,44
BARCLAYS BANK PLC 250923 OISEST 0.14	EUR	10 000 000	10 006 002,48	0,88
COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 070723 FIX 3.37	EUR	10 000 000	9 993 113,83	0,88
GLAXOSMITHKLINE FINANCE PLC 220923 FIX 3	EUR	10 000 000	9 914 450,98	0,88
MITSUBISHI HC CAPITAL UK PLC 080923 FIX 3.69	EUR	10 000 000	9 928 013,88	0,88
NORD BKP LOND BRAN ZCP 17-01-24	EUR	3 000 000	2 934 696,15	0,26
NTT FINANCE UK LIMITED 280723 FIX 3.45	EUR	5 000 000	4 986 291,03	0,44
SSE PLC. 150923 FIX 3.65	EUR	10 000 000	9 921 544,50	0,88
SSE PLC. 310723 FIX 3.43	EUR	5 000 000	4 984 942,95	0,45
THE TORO BANK LOND ZCP 12-12-23	EUR	6 000 000	5 896 962,13	0,52
THE TORONTO-DOM 111023 FIX 2.66	EUR	3 000 000	2 969 849,00	0,26
UNICREDIT SPA-LONDON BRANCH 210923 OISES	EUR	5 000 000	5 047 442,77	0,45
TOTAL ROYAUME-UNI			110 072 972,69	9,75
SUEDE				
SCANIA CV AB 230823 FIX 3.61	EUR	5 000 000	4 971 949,90	0,44
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 130923	EUR	10 000 000	9 926 920,59	0,87
SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 201023	EUR	5 000 000	4 944 027,02	0,44
SVENSKA HANDELSBANKEN AB 131123 FIX 3.62	EUR	15 000 000	14 788 943,29	1,31
SWEDBANK AB 201023 FIX 3.605	EUR	5 000 000	4 943 838,43	0,44
SWEDBANK AB 260723 FIX 2.43	EUR	5 000 000	4 987 758,21	0,45
VOLVO TREASURY AB 120723 FIX 3.45	EUR	7 000 000	6 991 831,54	0,62
TOTAL SUEDE			51 555 268,98	4,57
TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			724 471 228,43	64,17

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ETATS-UNIS				
FIDE NATL INFO SER ZCP 10-07-24	EUR	5 000 000	4 985 147,03	0,44
FIDE NATL INFO SER ZCP 10-07-24	EUR	10 000 000	9 970 294,06	0,88
FISERV ZCP 20-07-23	EUR	1 500 000	1 497 120,74	0,14
FISERV ZCP 27-07-23	EUR	5 000 000	4 987 064,05	0,44
TOTAL ETATS-UNIS			21 439 625,88	1,90
FINLANDE				
NORDEA BKP ZCP 05-10-23	EUR	1 000 000	990 037,84	0,09
TOTAL FINLANDE			990 037,84	0,09
ITALIE				
RCP 18/07/23 SNAMSPA EUR F 3.57	EUR	10 000 000	9 982 126,15	0,89
UNICREDIT ZCP 04-12-23	EUR	10 000 000	9 831 938,98	0,87
TOTAL ITALIE			19 814 065,13	1,76
PAYS-BAS				
HEINEKEN NV ZCP 24-08-23	EUR	3 000 000	2 983 622,00	0,26
TOTAL PAYS-BAS			2 983 622,00	0,26
ROYAUME-UNI				
BANK OF AMERICA NA LONDRES 140823 FIX 3.	EUR	5 000 000	4 978 017,34	0,44
BARCLAYS BANK PLC 210823 OISEST 0.23	EUR	5 000 000	5 057 622,32	0,45
THE TORO BANK LOND ZCP 18-06-24	EUR	10 000 000	9 613 294,02	0,85
TOTAL ROYAUME-UNI			19 648 933,68	1,74
SUEDE				
SKAN ENSK BANK AB ZCP 13-10-23	EUR	10 000 000	9 895 488,39	0,87
TOTAL SUEDE			9 895 488,39	0,87
TOTAL Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé			74 771 772,92	6,62
TOTAL Titres de créances			799 243 001,35	70,79
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
AMUNDI EURO LIQUIDITY-RATED SRI Part Z	EUR	19,091	19 341 798,91	1,71
AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI PART Z C	EUR	30,003	30 406 570,69	2,69
TOTAL FRANCE			49 748 369,60	4,40
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			49 748 369,60	4,40
TOTAL Organismes de placement collectif			49 748 369,60	4,40
Instrument financier à terme				
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				
OISEST/0.0/FIX/0.727	EUR	9 894 948	123 416,51	0,01
OISEST/0.0/FIX/0.904	EUR	9 881 108	96 528,60	0,01
OISEST/0.0/FIX/2.081	EUR	976 935	4 873,39	
OISEST/0.0/FIX/2.279	EUR	4 909 529	5 856,03	
OISEST/0.0/FIX/2.306	EUR	2 923 153	6 212,31	
OISEST/0.0/FIX/2.373	EUR	2 921 216	7 363,48	
OISEST/0.0/FIX/2.59	EUR	1 944 502	8 682,37	0,01
OISEST/0.0/FIX/2.768	EUR	4 929 289	1 295,99	

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OISEST/0.0/FIX/2.904	EUR	9 871 436	227,36	
OISEST/0.0/FIX/3.0	EUR	4 920 585	184,74	
OISEST/0.0/FIX/3.073	EUR	2 900 905	6 339,68	
OISEST/0.0/FIX/3.08	EUR	4 835 478	12 977,82	
OISEST/0.0/FIX/3.09	EUR	4 959 196	533,14	
OISEST/0.0/FIX/3.098	EUR	600 000	52,37	
OISEST/0.0/FIX/3.134	EUR	4 876 126	4 189,63	
OISEST/0.0/FIX/3.142	EUR	4 964 931	-182,59	
OISEST/0.0/FIX/3.179	EUR	1 500 000	-58,51	
OISEST/0.0/FIX/3.182	EUR	2 975 592	-134,86	
OISEST/0.0/FIX/3.22	EUR	1 500 000	-151,99	
OISEST/0.0/FIX/3.231	EUR	6 941 830	-804,30	
OISEST/0.0/FIX/3.237	EUR	4 979 247	37,23	
OISEST/0.0/FIX/3.237	EUR	4 980 967	3,50	
OISEST/0.0/FIX/3.244	EUR	9 857 558	3 159,07	
OISEST/0.0/FIX/3.256	EUR	1 491 231	28,64	
OISEST/0.0/FIX/3.256	EUR	1 491 231	28,64	
OISEST/0.0/FIX/3.26	EUR	5 948 574	-528,15	
OISEST/0.0/FIX/3.262	EUR	4 955 616	-378,63	
OISEST/0.0/FIX/3.274	EUR	4 965 736	96,27	
OISEST/0.0/FIX/3.278	EUR	4 958 015	-810,38	
OISEST/0.0/FIX/3.284	EUR	9 971 995	-4,70	
OISEST/0.0/FIX/3.285	EUR	2 000 000	-335,68	
OISEST/0.0/FIX/3.291	EUR	9 827 156	5 015,98	
OISEST/0.0/FIX/3.293	EUR	4 970 425	30,76	
OISEST/0.0/FIX/3.3	EUR	4 985 147	11,82	
OISEST/0.0/FIX/3.3	EUR	9 970 294	23,64	
OISEST/0.0/FIX/3.305	EUR	4 955 745	276,46	
OISEST/0.0/FIX/3.313	EUR	4 949 977	663,35	
OISEST/0.0/FIX/3.318	EUR	9 914 110	432,42	
OISEST/0.0/FIX/3.319	EUR	2 991 225	11,95	
OISEST/0.0/FIX/3.321	EUR	9 914 110	-644,08	
OISEST/0.0/FIX/3.325	EUR	4 910 771	-3 288,45	
OISEST/0.0/FIX/3.327	EUR	1 491 024	18,03	
OISEST/0.0/FIX/3.329	EUR	9 971 539	23,09	
OISEST/0.0/FIX/3.331	EUR	2 000 000	101,45	
OISEST/0.0/FIX/3.335	EUR	9 972 385	23,99	
OISEST/0.0/FIX/3.348	EUR	19 936 910	44,45	
OISEST/0.0/FIX/3.35	EUR	3 489 221	7,85	
OISEST/0.0/FIX/3.350	EUR	4 984 009	8,94	
OISEST/0.0/FIX/3.354	EUR	4 954 293	311,95	
OISEST/0.0/FIX/3.355	EUR	9 968 367	33,17	
OISEST/0.0/FIX/3.367	EUR	1 963 280	-1 636,86	
OISEST/0.0/FIX/3.367	EUR	7 853 120	-6 547,43	
OISEST/0.0/FIX/3.375	EUR	14 956 252	71,42	
OISEST/0.0/FIX/3.379	EUR	2 000 000	40,09	
OISEST/0.0/FIX/3.379	EUR	1 000 000	20,05	
OISEST/0.0/FIX/3.38	EUR	7 976 204	8,22	

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OISEST/0.0/FIX/3.385	EUR	6 985 272	8,67	
OISEST/0.0/FIX/3.4	EUR	9 957 162	153,66	
OISEST/0.0/FIX/3.402	EUR	1 000 000	22,27	
OISEST/0.0/FIX/3.403	EUR	9 912 287	571,88	
OISEST/0.0/FIX/3.405	EUR	9 939 062	147,86	
OISEST/0.0/FIX/3.407	EUR	2 000 000	65,29	
OISEST/0.0/FIX/3.42	EUR	4 907 937	-4 628,12	
OISEST/0.0/FIX/3.437	EUR	1 400 000	100,41	
OISEST/0.0/FIX/3.437	EUR	4 910 021	-222,40	
OISEST/0.0/FIX/3.438	EUR	4 910 021	-247,19	
OISEST/0.0/FIX/3.442	EUR	9 906 580	729,22	
OISEST/0.0/FIX/3.456	EUR	9 936 876	162,91	
OISEST/0.0/FIX/3.465	EUR	9 910 344	738,07	
OISEST/0.0/FIX/3.467	EUR	14 726 054	5 810,88	
OISEST/0.0/FIX/3.471	EUR	2 100 000	153,47	
OISEST/0.0/FIX/3.474	EUR	900 000	60,06	
OISEST/0.0/FIX/3.476	EUR	9 782 318	4 685,11	
OISEST/0.0/FIX/3.48	EUR	2 981 218	37,97	
OISEST/0.0/FIX/3.482	EUR	2 000 000	4,98	
OISEST/0.0/FIX/3.483	EUR	9 907 584	724,37	
OISEST/0.0/FIX/3.492	EUR	6 380 175	2 583,72	
OISEST/0.0/FIX/3.508	EUR	4 872 984	4 296,38	
OISEST/0.0/FIX/3.509	EUR	4 860 303	6 197,52	
OISEST/0.0/FIX/3.519	EUR	4 923 987	1 207,23	
OISEST/0.0/FIX/3.545	EUR	9 911 613	410,97	
OISEST/0.0/FIX/3.561	EUR	5 773 499	9 285,62	
OISEST/0.0/FIX/3.57	EUR	7 728 401	259,90	
OISEST/0.0/FIX/3.606	EUR	5 888 058	1 916,23	
OISEST/0.0/FIX/3.755	EUR	9 601 013	7 219,85	
TOTAL Swaps de taux			316 216,03	0,03
TOTAL Autres instruments financiers à terme			316 216,03	0,03
TOTAL Instrument financier à terme			316 216,03	0,03
Créances			17 919 490,20	1,59
Dettes			-18 278 231,40	-1,62
Comptes financiers			164 618 100,27	14,58
Actif net			1 128 936 200,18	100,00