

GASPAL OBLIGATIONS COURT TERME

DOCUMENT D'INFORMATION PERIODICITE SEMESTRIELLE AU 29/12/2023

FORME JURIDIQUE DE L'OPC

FCP Général

CLASSIFICATION

Obligations et autres titres créances EURO

AFFECTATION DES RESULTATS

Résultat capitalisable

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 du code monétaire et financier	107 163 125,04
b) Avoirs bancaires	0,00
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	4 815 215,28
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	111 978 340,32
e) Passif	-3 315 261,43
f) Valeur nette d'inventaire	108 663 078,89

* Les montants sont signés

NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART OU ACTION

Part	Type de part	Actif net	Nombre de parts en circulation	Valeur liquidative
II GASPAL OB.C.T.I 4D	Capitalisation	107 352 932,65	775 240,0194	138,47
S1 GASPAL C.T.S FCP4D	Capitalisation	1 310 146,24	12 706,00	103,11

ELEMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres :	Pourcentage	
	Actif net	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	94,04	91,26
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	0,00	0,00
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Les autres actifs	4,58	4,44

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B) ET F) DE L'ARTICLE R. 214-1-1, PAR DEVISE

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
			Actif net	Total des actifs
LAGARD NCP 15012024	EUR	2 993 904,07	2,78	2,65
ITALY 0%310124	EUR	2 991 570,00	2,75	2,67
SOC.GEN.TV26	EUR	2 920 228,77	2,69	2,61
PLASTIC OM 1,25%24	EUR	2 778 365,03	2,56	2,48
ACCOR 2,50%24	EUR	2 654 738,19	2,44	2,37
NEXANS NCP20032024	EUR	2 574 913,90	2,37	2,30
INTERC.INDX RTG24	EUR	2 467 831,76	2,27	2,20
SODEXO 0,5%170124	EUR	2 458 448,14	2,26	2,20
FRVIA NCP18102024	EUR	2 416 225,44	2,22	2,16
REXEL NCP 12012024	EUR	2 196 436,85	2,02	1,96
BBVA TV100526	EUR	2 066 547,54	1,90	1,85
CARMILA 2.375%24	EUR	1 984 986,17	1,83	1,77
BARCLAYS TV020425	EUR	1 938 510,75	1,78	1,73
BFCM 3%210524	EUR	1 826 489,80	1,68	1,63
CA SA 2,85%0426	EUR	1 774 499,25	1,63	1,58
BNP PARIBA 2,75%26	EUR	1 730 365,03	1,59	1,55
BFCM 0,01%110526	EUR	1 581 025,08	1,45	1,41
ORANO 4,875%09-24	EUR	1 528 749,10	1,41	1,37
BEL 1,5%24	EUR	1 503 833,61	1,38	1,34
EUROFINS 2,125%24	EUR	1 497 758,61	1,38	1,34
SEB 1,5%310524	EUR	1 496 780,16	1,38	1,34
BUREAU V 1,875%25	EUR	1 495 973,84	1,38	1,34
CNH IND FIN 0%24	EUR	1 485 090,00	1,37	1,33
BARCLAYS 1,375%26	EUR	1 476 913,36	1,36	1,32
STELLANTIS 3,75%24	EUR	1 439 309,93	1,32	1,29
URW 2,5%24	EUR	1 426 993,92	1,31	1,27
CIE DE SAINT- TV24	EUR	1 211 183,83	1,11	1,08
HARLEY D 5,125%26	EUR	1 070 707,46	0,99	0,96
AIRFR-KLM 0,125%26	EUR	1 069 842,60	0,98	0,96
INTESA SANPA 4%26	EUR	1 039 957,32	0,96	0,93
ARVAL SE 3,375%26	EUR	1 033 307,53	0,95	0,92
CELLNEX T 2,375%24	EUR	1 022 424,11	0,94	0,91
ARCELORMI 2,25%24	EUR	1 020 786,99	0,94	0,91
VW INTL F 4,125%25	EUR	1 018 242,54	0,94	0,91
RCIB 4,125%011225	EUR	1 011 219,26	0,93	0,90
WORLDLINE 0%25 OCE	EUR	1 008 881,20	0,93	0,90
SOCI 02,625%15-25	EUR	1 008 484,52	0,93	0,90
BANCO SANTAND TV24	EUR	1 008 334,50	0,93	0,90
SANTANDER CON TV25	EUR	1 003 378,89	0,92	0,90
RCI BANQUE TV25	EUR	1 002 338,33	0,92	0,90

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
			Actif net	Total des actifs
FED CAISS DES TV24	EUR	1 001 799,78	0,92	0,89
VOLKSWAGEN 3,75%24	EUR	1 000 585,90	0,92	0,89
RCI BANQUE 2%24	EUR	999 527,49	0,92	0,89
ALTAREA 2,25%24	EUR	996 478,52	0,92	0,89
FORD MOT 1,744%24	EUR	994 325,25	0,92	0,89
MORGAN STANLE TV26	EUR	991 300,16	0,91	0,89
CASA 2,80%16 TSR	EUR	987 423,91	0,91	0,88
CAIXABANK TV130426	EUR	985 075,71	0,91	0,88
KLEPIERRE 1,75%24	EUR	984 083,22	0,91	0,88
UNICREDIT TV200126	EUR	982 801,10	0,90	0,88
IMERYS 2%1224 EMTN	EUR	982 301,48	0,90	0,88
C.AGR.2,8%15-25TSR	EUR	982 110,87	0,90	0,88
IBM 0,875%310125	EUR	980 218,77	0,90	0,88
LEASYS 0%220724	EUR	978 870,00	0,90	0,87
BBVA 0,375%021024	EUR	976 232,87	0,90	0,87
BNP CARDIF 1%24	EUR	973 046,28	0,90	0,87
MEDIOBAN 1,125%25	EUR	972 958,11	0,90	0,87
MONDELEZ 0%24 EXBD	EUR	971 210,00	0,89	0,87
ARCELORMI 1,75%25	EUR	965 871,64	0,89	0,86
VOLKSWAG FIN 0%25	EUR	961 270,00	0,88	0,86
INTESA 0,625%26	EUR	946 219,59	0,87	0,85
EURONEXT 0,125%26	EUR	931 628,93	0,86	0,83
SANTAND 0,125%26	EUR	928 631,64	0,85	0,83
COFACE 4,125%0324	EUR	927 713,51	0,85	0,83
SAGERPAR 0%0426 EC	EUR	919 910,00	0,85	0,82
COVIVIO 1,625%24	EUR	885 278,80	0,81	0,79
BNP PARIB 2,375%25	EUR	805 553,53	0,74	0,72
VOLKSWAGE 4,25%26	EUR	728 390,18	0,67	0,65
BFCM 0,125%050224	EUR	698 317,89	0,64	0,62
EXOR 2,5%081024	EUR	697 019,84	0,64	0,62
VIVENDI 0,875%24	EUR	687 573,64	0,63	0,61
BANCO SANTAND TV25	EUR	605 288,95	0,56	0,54
BANQ STEL 0,625%24	EUR	592 846,20	0,55	0,53
CTE 0,875%290924	EUR	588 207,05	0,54	0,53
RCI BQ 4,625% 26	EUR	522 678,85	0,48	0,47
CM ARKEA 1,25%24	EUR	498 550,60	0,46	0,45
MERCIALYS 1,8%26	EUR	486 173,84	0,45	0,43
ALD 1,25%020326	EUR	483 017,49	0,44	0,43
ICADE 1,125%25	EUR	477 057,34	0,44	0,43
ARVAL SE 4,625%24	EUR	403 825,49	0,37	0,36
CAPGEMINI 1%181024	EUR	392 177,53	0,36	0,35
URW 0,875%25	EUR	390 334,14	0,36	0,35
WORLDLIN.1,625%24	EUR	294 240,80	0,27	0,26
CELLNEX T 2,875%25	EUR	202 530,70	0,19	0,18
COVIVIO 1,875%26	EUR	195 190,07	0,18	0,17
TOTAL	EUR	102 191 425,04	94,04	91,26

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
			Actif net	Total des actifs
TOTAL		102 191 425,04	94,04	91,26

**REPARTITION DES ACTIFS DU A), B) ET F) DE L'ARTICLE R. 214-1-1, PAR
SECTEUR ECONOMIQUE**

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Banques ancien code ICB	33,67	32,65
Automobiles et équipementiers ancien code ICB	9,32	9,05
Voyage et Loisirs ancien code ICB	7,96	7,73
SOC PLACEMENT IMMOBILIER ancien code ICB	7,20	6,99
Finance générale ancien code ICB	5,47	5,31
Electronique & Equipements électriques ancien code ICB	4,39	4,26
Autres secteurs économiques	25,49	24,74
TOTAL	93,50	90,73

**REPARTITION DES ACTIFS DU A), B) ET F) DE L'ARTICLE R. 214-1-1 PAR
PAYS DE RESIDENCE DE L'EMETTEUR**

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
FRANCE	56,08	54,41
ITALIE	7,28	7,07
ESPAGNE	7,24	7,03
AUTRES PAYS	23,44	22,75
TOTAL	94,04	91,26

VENTILATION DES AUTRES ACTIFS PAR NATURE

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
PARTS D'OPC	0,00	0,00
▪ OPC et Fonds d'investissement à vocation générale (non-professionnels)	0,00	0,00
▪ FCPR, FCPI, FIP ouverts à des investisseurs non professionnels	0,00	0,00
▪ Organisme de titrisation	0,00	0,00
▪ OPCI, SCPI ouverts à des investisseurs non professionnels	0,00	0,00
▪ SEF, SICAF et fonds de fonds alternatifs	0,00	0,00
▪ Fonds professionnels à vocation générale (ouverts à des investisseurs professionnels)	0,00	0,00
▪ OPCI professionnels, Fonds professionnels spécialisés et fonds professionnels de capital investissements	0,00	0,00
▪ Autres placements collectifs	0,00	0,00
AUTRES NATURES D'ACTIFS	4,58	4,44
▪ Bons de souscription	0,00	0,00
▪ Bons de caisse	0,00	0,00
▪ Billets à ordre	0,00	0,00
▪ Billets hypothécaires	0,00	0,00
▪ Autres	4,58	4,44
TOTAL	4,58	4,44

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE EN COURS DE PERIODE

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	95 057 064,30
Cessions	77 925 918,54

Règlement SFTR

Cet 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 réutilisation (« Règlement SFTR ») au cours de la période et n'a donc pas d'information à communiquer aux investisseurs à ce titre.

PORTEFEUILLE TITRES DETAILLE

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
TOTAL Obligations & Valeurs assimilées						89 018 374,78	81,92
TOTAL Obligations & valeurs assimilées négo. sur un marché régl. ou assimilé						89 018 374,78	81,92
TOTAL Obligations à taux fixe négo. sur un marché régl. ou assimilé						68 471 537,79	63,01
TOTAL ALLEMAGNE						1 689 660,18	1,55
XS2374595127 VOLKSWAG FIN SVCS 0%21-120225	12/08/2021	12/02/2025	EUR	1000		961 270,00	0,88
XS2617442525 VOLKSWAGEN BANK 4,25%23-070126	25/04/2023	07/01/2026	EUR	7	4.25	728 390,18	0,67
TOTAL ESPAGNE						5 252 810,93	4,83
XS1468525057 CELLNEX TELECOM 2,375%16-0124	10/08/2016	16/01/2024	EUR	10	2.375	1 022 424,11	0,94
XS1551726810 CELLNEX TELECOM 2,875%17-0425	18/01/2017	18/04/2025	EUR	2	2.875	202 530,70	0,19
XS2058729653 BBVA 0,375%19-021024	02/10/2019	02/10/2024	EUR	10	0.375	976 232,87	0,90
XS2468378059 CAIXABANK TV22-130426	13/04/2022	13/04/2026	EUR	10		985 075,71	0,91
XS2620201421 BBVA TV23-100526	02/05/2023	10/05/2026	EUR	20		2 066 547,54	1,89
TOTAL FRANCE						38 171 358,79	35,15
FR0010804500 ORANO 4,875%09-230924 EMTN	23/09/2009	23/09/2024	EUR	30	4.875	1 528 749,10	1,41
FR0012283653 KLEPIERRE 1,75%14-061124 EMTN	06/11/2014	06/11/2024	EUR	10	1.75	984 083,22	0,91
FR0012370872 IMERYYS 2%14-101224 EMTN	10/12/2014	10/12/2024	EUR	10	2.00	982 301,48	0,90
FR0013142536 CARMILA 2.375%16-160924 ST.AL.	24/03/2016	16/09/2024	EUR	20	2.375	1 984 986,17	1,83

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
FR0013170834 COVIVIO 1,875%16-200526	20/05/2016	20/05/2026	EUR	2	1.875	195 190,07	0,18
FR0013218393 ICADE 1,125%16 171125	15/11/2016	17/11/2025	EUR	5	1.125	477 057,34	0,44
FR0013233384 ACCOR 2,50%17-250124	25/01/2017	25/01/2024	EUR	26	2.50	2 654 738,19	2,44
FR0013251329 BEL 1,5%17-180424	18/04/2017	18/04/2024	EUR	15	1.50	1 503 833,61	1,38
FR0013258936 CM ARKEA 1,25%17-310524	31/05/2017	31/05/2024	EUR	5	1.25	498 550,60	0,46
FR0013259116 SEB 1,5%17-310524	31/05/2017	31/05/2024	EUR	15	1.50	1 496 780,16	1,38
FR0013264066 PLASTIC OMNIUM 1,25%17-260624	26/06/2017	26/06/2024	EUR	28	1.25	2 778 365,03	2,56
FR0013264405 CTE 0,875%17-290924	29/06/2017	29/09/2024	EUR	6	0.875	588 207,05	0,54
FR0013266525 ALTAREA 2,25%17-050724	05/07/2017	05/07/2024	EUR	10	2.25	996 478,52	0,92
FR0013281946 WORLDLINE 1,625%17-130924	13/09/2017	13/09/2024	EUR	3	1.625	294 240,80	0,27
FR0013282571 VIVENDI 0,875%17-180924 EMTN	18/09/2017	18/09/2024	EUR	7	0.875	687 573,64	0,63
FR0013320249 MERCIALYS 1,8%18-270226	20/02/2018	27/02/2026	EUR	5	1.80	486 173,84	0,45
FR0013327962 CAPGEMINI 1%18-181024	18/04/2018	18/10/2024	EUR	4	1.00	392 177,53	0,36
FR0013370129 BUREAU VERITAS 1,875%18-060125	04/10/2018	06/01/2025	EUR	15	1.875	1 495 973,84	1,38
FR0013393774 RCI BANQUE 2%19-110724	11/01/2019	11/07/2024	EUR	1000	2.00	999 527,49	0,92
FR0013432770 BFCM 0,125%19-050224	04/07/2019	05/02/2024	EUR	7	0.125	698 317,89	0,64
FR0013509098 SOCIETEGENERALE TV20-0426	21/04/2020	21/04/2026	EUR	30		2 920 228,77	2,72
FR0014002S57 BFCM 0,01%21-110526	08/04/2021	11/05/2026	EUR	17	0.01	1 581 025,08	1,45
FR001400BDD5 ARVAL SERV LEAS 3,375%22-0126	04/07/2022	04/01/2026	EUR	10	3.375	1 033 307,53	0,95

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
FR001400E904 RCIB 4,125%22-011225 EMTN	01/12/2022	01/12/2025	EUR	1000	4.125	1 011 219,26	0,93
FR001400FOU6 RCI BQ 4,625%23-130726 EMTN	13/01/2023	13/07/2026	EUR	500	4.625	522 678,85	0,48
FR001400I9F5 ARVAL SERV LEAS 4,625%23-1224	02/06/2023	02/12/2024	EUR	4	4.625	403 825,49	0,37
XS1038708522 URW 2,5%14-260224 EMTN	26/02/2014	26/02/2024	EUR	1400	2.50	1 426 993,92	1,31
XS1195574881 SOC.GENERAL02,625%15-270225	27/02/2015	27/02/2025	EUR	10	2.625	1 008 484,52	0,93
XS1325645825 BNP PARIBAS 2,75%15-270126	27/11/2015	27/01/2026	EUR	1700	2.75	1 730 365,03	1,59
XS1523192588 URW 0,875%16-0225	22/11/2016	21/02/2025	EUR	400	0.875	390 334,14	0,36
XS1698714000 COVIVIO 1,625%17-1024	17/10/2017	17/10/2024	EUR	900	1.625	885 278,80	0,81
XS2015267953 BQE STELLANTIS 0,625%19-210624	21/06/2019	21/06/2024	EUR	600	0.625	592 846,20	0,55
XS2203995910 SODEXO 0,5%20-170124	17/07/2020	17/01/2024	EUR	2450	0.50	2 458 448,14	2,26
XS2451372499 ALD 1,25%22-020326	02/03/2022	02/03/2026	EUR	5	1.25	483 017,49	0,44
TOTAL ROYAUME UNI						3 415 424,11	3,14
XS1757394322 BARCLAYS 1,375%18-240126 NOTES	24/01/2018	24/01/2026	EUR	1500		1 476 913,36	1,36
XS2150054026 BARCLAYS TV20-020425	02/04/2020	02/04/2025	EUR	1895		1 938 510,75	1,78
TOTAL ITALIE						4 920 806,12	4,53
XS2104967695 UNICREDIT TV20-200126	20/01/2020	20/01/2026	EUR	1000		982 801,10	0,90
XS2106861771 MEDIOBANCA 1,125%20-230425	23/01/2020	23/04/2025	EUR	1000	1.125	972 958,11	0,90
XS2304664167 INTESA SANPA 0,625%21-240226	22/02/2021	24/02/2026	EUR	1000	0.625	946 219,59	0,87
XS2366741770 LEASYS 0%21-220724	22/07/2021	22/07/2024	EUR	1000		978 870,00	0,90

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
XS2625195891 INTESA SANPAOLO 4%23-190526	19/05/2023	19/05/2026	EUR	1000	4.00	1 039 957,32	0,96
TOTAL LUXEMBOURG						4 969 507,24	4,57
XS1651444140 EUROFINIS SCIENTIFI 2,125%17-24	25/07/2017	25/07/2024	EUR	1500	2.125	1 497 758,61	1,37
XS1936308391 ARCELORMITTAL 2,25%19-170124	17/01/2019	17/01/2024	EUR	1000	2.25	1 020 786,99	0,94
XS2082324018 ARCELORMITTAL 1,75%19-191125	19/11/2019	19/11/2025	EUR	1000	1.75	965 871,64	0,89
XS2264980363 CNH IND FIN 0%20-010424	01/12/2020	01/04/2024	EUR	1500		1 485 090,00	1,37
TOTAL PAYS-BAS						5 086 787,14	4,68
DK0030485271 EURONEXT 0,125% 17052026	17/05/2021	17/05/2026	EUR	1000	0.125	931 628,93	0,86
XS1119021357 EXOR 2,5%14-081024	08/10/2014	08/10/2024	EUR	700	2.50	697 019,84	0,64
XS1388625425 STELLANTIS 3,75%16-290324	30/03/2016	29/03/2024	EUR	1400	3.75	1 439 309,93	1,32
XS2554487905 VW INTL FIN.4,125%22-151125	15/11/2022	15/11/2025	EUR	10	4.125	1 018 242,54	0,94
XS2560100468 VOLKSWAGEN FCIAL 3,75%22-1124	25/11/2022	25/11/2024	EUR	10	3.75	1 000 585,90	0,92
TOTAL NORVEGE						928 631,64	0,85
XS2331216577 SANTAND CONS BK 0,125%21-0426	14/04/2021	14/04/2026	EUR	10	0.125	928 631,64	0,85
TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE						4 036 551,64	3,71
XS1944456109 IBM 0,875%19-310125	31/01/2019	31/01/2025	EUR	1000	0.875	980 218,77	0,90
XS2116728895 FORD MOT 1,744%24	20/02/2020	19/07/2024	EUR	1000	1.744	994 325,25	0,92
XS2446386356 MORGAN STANLEY TV22-080526	10/05/2022	08/05/2026	EUR	1000		991 300,16	0,91
XS2607183980 HARLEY DAVIDS FIN 5,125%23-26	05/04/2023	05/04/2026	EUR	1000	5.125	1 070 707,46	0,98

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
TOTAL Obligations à taux variable, révisable négo. sur un marché régl. ou assimilé						5 832 324,28	5,37
TOTAL CANADA						1 001 799,78	0,92
XS2696112437 FED CAISS DESJARD TV23-270924	27/09/2023	27/09/2024	EUR	10		1 001 799,78	0,92
TOTAL ESPAGNE						2 617 002,34	2,41
XS1717591884 BANCO SANTANDER TV17-211124 32	21/11/2017	21/11/2024	EUR	10		1 008 334,50	0,93
XS2115156270 BANCO SANTANDER TV20-110225	11/02/2020	11/02/2025	EUR	6		605 288,95	0,56
XS2684980365 SANTANDER CONSUM FI TV23-0325	14/09/2023	14/03/2025	EUR	10		1 003 378,89	0,92
TOTAL FRANCE						2 213 522,16	2,04
FR0013322146 RCI BANQUE TV18-120325	12/03/2018	12/03/2025	EUR	10		1 002 338,33	0,92
XS2576245364 CIE DE SAINT-GOBAIN TV23-0724	09/01/2023	18/07/2024	EUR	12		1 211 183,83	1,12
TOTAL Obligations convertibles négo. sur un marché régl. ou assimilé						3 969 843,80	3,65
TOTAL BELGIQUE						919 910,00	0,85
BE6327660591 SAGERPAR 0%21-010426 ECH.	01/04/2021	01/04/2026	EUR	10		919 910,00	0,85
TOTAL FRANCE						2 078 723,80	1,91
FR0013410628 AIRFR-KLM 0,125% 19-0326 OCEANE	25/03/2019	25/03/2026	EUR	60300	0.125	1 069 842,60	0,98
FR0013526803 WORLDLINE 0%20-300725 OCEANE	30/07/2020	30/07/2025	EUR	9200		1 008 881,20	0,93
TOTAL PAYS-BAS						971 210,00	0,89
XS2388456456 MONDELEZ 0%21-200924 EXBD	20/09/2021	20/09/2024	EUR	5		971 210,00	0,89
TOTAL Obligations indexées négo. sur un marché régl. ou assimilé						2 467 831,76	2,27

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
TOTAL ROYAUME UNI						2 467 831,76	2,27
XS2240494471 INTERC.HOTELS INDX RTG20-1024	08/10/2021	08/10/2024	EUR	2500	1.625	2 467 831,76	2,27
TOTAL Titres subordonnés (TSR - TSDI)						8 276 837,15	7,62
TOTAL FRANCE						8 276 837,15	7,62
FR0011805803 COFACE 4,125% 14-270324	27/03/2014	27/03/2024	EUR	9	4.125	927 713,51	0,85
FR0012891992 CRED.AGRIC.2,80% 15-161025 TSR	16/10/2015	16/10/2025	EUR	1000000	2.80	982 110,87	0,90
FR0013076353 CRED.AGRICOL.2,80% 16-270126TSR	27/01/2016	27/01/2026	EUR	1000000	2.80	987 423,91	0,91
FR0013134897 CA SA 2,85% 16-270426	27/04/2016	27/04/2026	EUR	1800761	2.85	1 774 499,25	1,63
FR0013299641 BNP CARDIF 1% 17-291124	29/11/2017	29/11/2024	EUR	10	1.00	973 046,28	0,90
XS1069549761 BFCM 3% 14-210524 EMTN SUB	21/05/2014	21/05/2024	EUR	1800	3.00	1 826 489,80	1,69
XS1190632999 BNP PARIBAS 2,375% 15-170225	17/02/2015	17/02/2025	EUR	800	2.375	805 553,53	0,74
TOTAL Titres de créances						18 144 750,26	16,70
TOTAL Titres de créances négociés sur un marché régl. ou assimilé						18 144 750,26	16,70
TOTAL Titres de créances négociables						18 144 750,26	16,70
TOTAL FRANCE						15 153 180,26	13,95
FR0128198555 LAGARD NCP 15012024	11/09/2023	15/01/2024	EUR	3000000		2 993 904,07	2,76
FR0128255959 REXEL NCP 12012024	10/10/2023	12/01/2024	EUR	2200000		2 196 436,85	2,02
FR0128258078 FRVIA NCP18102024	16/10/2023	18/10/2024	EUR	2500000		2 416 225,44	2,22
FR0128297175 NEXANS NCP20032024	16/11/2023	20/03/2024	EUR	2600000		2 574 913,90	2,37

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
FR0128070994 FRA.BT BNT28022024	27/09/2023	28/02/2024	EUR	5000000		4 971 700,00	4,58
TOTAL ITALIE						2 991 570,00	2,75
IT0005557365 ITALY 0%23-310124	31/07/2023	31/01/2024	EUR	3000		2 991 570,00	2,75
TOTAL Contrats financiers						0,00	0,00
TOTAL Contrats financiers avec appel de marge						0,00	0,00
TOTAL Engagements à terme fermes						0,00	0,00
FGBSH4F00002 SCHATZ-EUX 0324			EUR	-100		-32 000,00	-0,03
TOTAL FRANCE						32 000,00	0,00
MARF.EUR Appels marge futures			EUR	32000		32 000,00	0,00