

# **SG LIQUIDITE PEA**

**Rapport annuel**

**Exercice clos le : 31.03.2021**

## **FCP de Société Générale Gestion**

**Société de gestion : SOCIETE GENERALE GESTION**

**Sous déléataire de gestion comptable en titre : SOCIETE GENERALE**

**Dépositaire : SOCIETE GENERALE**

**Commissaire aux comptes : DELOITTE & ASSOCIÉS**

# SG LIQUIDITE PEA

## Sommaire

Caractéristiques du FCP	3
Vie du FCP sur l'exercice sous revue	4
Rapport d'activité	6
Informations spécifiques	7
Informations réglementaires	8
Techniques de gestion efficace du portefeuille et instruments financiers dérivés	11
Certification du commissaire aux comptes sur les comptes annuels	12
Comptes annuels	16
Bilan	17
Actif	17
Passif	18
Hors-bilan	19
Compte de résultat	20
Règles & méthodes comptables	21
Évolution actif net	24
Compléments d'information	25
Inventaire	32
Comptes annuels au 31.03.2021 du Fonds maître AMUNDI SERENITE PEA	34

## Caractéristiques du FCP



### Caractéristiques principales du fonds

Ce document fournit des informations essentielles aux investisseurs de ce fonds. Il ne s'agit pas d'un document promotionnel. Les informations qu'il contient vous sont fournies conformément à une obligation légale, afin de vous aider à comprendre en quoi consiste un investissement dans ce fonds et quels risques y sont associés. Il vous est conseillé de le lire pour décider en connaissance de cause d'investir ou non.

#### SG LIQUIDITE PEA

Code ISIN : (C) FR0007010657

OPCVM de droit français géré par Société Générale Gestion, société de Amundi

#### Objectifs et politique d'investissement

Classification AMF ("Autorité des Marchés Financiers") : Non applicable

En souscrivant à SG LIQUIDITE PEA, nourricier de AMUNDI SERENITE PEA, vous investissez les liquidités de votre PEA au travers de AMUNDI SERENITE PEA - O.

En effet, votre investissement est réalisé en quasi-totalité dans AMUNDI SERENITE PEA - O et, accessoirement en liquidités.

La stratégie de votre fonds est identique à celle de AMUNDI SERENITE PEA - O, à savoir :

**Rappel de l'objectif de gestion du fonds maître :**

*Ce fonds est destiné au placement des liquidités en attente de réinvestissement dans le cadre d'un PEA. L'objectif de gestion du fonds est d'investir dans des titres éligibles au PEA afin de bénéficier de la fiscalité associée et d'échanger la performance de ces titres contre la performance du marché monétaire, l'Eonia. La gestion mise en œuvre vise ainsi à offrir aux porteurs, sur un horizon de placement de 1 mois, un rendement monétaire tout en leur permettant de bénéficier de l'avantage fiscal lié à l'éligibilité PEA. En cas de très faible niveau des taux d'intérêt du marché monétaire, le rendement dégagé par le fonds ne suffirait pas à couvrir les frais de gestion. L'OPC verrait sa valeur liquidative baisser de manière structurelle.*

Les frais courants propres au fonds nourricier doivent être pris en compte pour l'appréciation de son objectif de gestion. Ainsi, l'objectif de gestion du fonds nourricier est de faire l'Eonia diminué de ses propres frais courants après prise en compte des frais courants du maître. Aussi, compte tenu de ses propres frais courants, la performance du fonds nourricier est inférieure à celle de son maître. Cette performance sera en outre ajustée des coûts ou des gains liés à l'éligibilité au PEA.

**Rappel de la politique d'investissement du fonds maître :**

*Ainsi, l'équipe de gestion gère un portefeuille de titres éligibles au PEA et échange la performance contre celle du marché monétaire via l'utilisation de dérivés.*

*AMUNDI SERENITE PEA pourra conclure des acquisitions et cessions temporaires de titres. Des instruments financiers à terme seront utilisés à titre de couverture et/ou d'exposition et pourra générer une surexposition pouvant ainsi porter l'exposition de l'OPC au-delà de l'actif net du fonds.*

SG LIQUIDITE PEA est éligible au PEA.

L'OPC est géré passivement et a pour objectif de répliquer la performance de son indice.

L'OPC maître est soumis à un risque en matière de durabilité au sens du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (dit « Règlement Disclosure ») tel que défini dans le profil de risque du prospectus.

Le résultat net et les plus-values nettes réalisées du fonds sont systématiquement réinvestis chaque année.

Vous pouvez demander le remboursement de vos parts chaque jour, les opérations de rachat sont exécutées de façon quotidienne.

Recommandation : ce fonds pourrait ne pas convenir aux investisseurs qui prévoient de retirer leur apport avant 6 mois.

#### Profil de risque et de rendement

à risque plus faible,

à risque plus élevé,

rendement potentiellement plus faible      rendement potentiellement plus élevé



Le niveau de risque de ce FCP reflète principalement le risque de son indice de référence EONIA.

Les données historiques utilisées pour le calcul de l'indicateur de risque numérique pourraient ne pas constituer une indication fiable du profil de risque futur de l'OPCVM.

La catégorie de risque associée à ce fonds n'est pas garantie et pourra évoluer dans le temps.

La catégorie la plus faible ne signifie pas « sans risque ».

Le capital initialement investi ne bénéficie d'aucune garantie.

Les dispositions en matière de souscription/rachat de AMUNDI SERENITE PEA - O, dans lequel est investi votre fonds, sont expliquées dans la partie Conditions de souscriptions et de rachats du prospectus de AMUNDI SERENITE PEA - O.

Les risques importants pour l'OPCVM non pris en compte dans l'indicateur sont :

- Risque de crédit : il représente le risque de dégradation soudaine de la qualité de signature d'un émetteur ou celui de sa défaillance.
- Risque de contrepartie : il représente le risque de défaillance d'un intervenant de marché l'empêchant d'honorer ses engagements vis-à-vis de votre portefeuille.
- L'utilisation de produits complexes tels que les produits dérivés peut entraîner une amplification des mouvements de titres dans votre portefeuille.

La survenance de l'un de ces risques peut entraîner une baisse de la valeur liquidative du portefeuille.

# SG LIQUIDITE PEA

## Vie du FCP sur l'exercice sous revue

En date du 11 février 2021 :

### - Ajout dans le DICI :

L'OPC maître est soumis à un risque en matière de durabilité au sens du Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (dit « Règlement Disclosure ») tel que défini dans le profil de risque du prospectus.

### - Modification dans le DICI :

Avant :

Les informations clés pour l'investisseur ici fournies sont exactes et à jour au 28 août 2020.

Après :

Les informations clés pour l'investisseur ici fournies sont exactes et à jour au 11 février 2021.

### - Ajout dans la note détaillée :

"L'OPC est soumis à un risque en matière de durabilité tel que défini dans le profil de risque.

L'OPC intègre des facteurs de durabilité dans son processus d'investissement. En effet, Amundi applique une Politique d'Investissement Responsable qui consiste d'une part en une politique d'exclusions ciblées selon la stratégie d'investissement et d'autre part en un système de notations ESG mis à la disposition de l'équipe de gestion (le détail de cette politique est disponible dans la Politique Investissement Responsable d'Amundi disponible sur le site [www.amundi.fr](http://www.amundi.fr)).

Au regard du règlement (UE) 2016/1011 du Parlement européen et du conseil du 08 juin 2016, la société de gestion dispose d'une procédure de suivi des indices de référence utilisés décrivant les mesures à mettre en œuvre en cas de modifications substantielles apportées à un indice ou cessation de fourniture de cet indice. "Au regard du règlement (UE) 2016/1011 du Parlement européen et du conseil du 08 juin 2016, la société de gestion dispose d'une procédure de suivi des indices de référence utilisés décrivant les mesures à mettre en œuvre en cas de modifications substantielles apportées à un indice ou cessation de fourniture de cet indice.

Risque en matière de durabilité : il s'agit du risque lié à un événement ou une situation dans le domaine environnemental, social ou de gouvernance qui, s'il survient, pourrait avoir une incidence négative importante, réelle ou potentielle, sur la valeur de l'investissement

Non applicable

"Règlement (UE) 2019/2088 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (dit « Règlement Disclosure »)

En tant qu'acteur des marchés financiers, la société de gestion de l'OPC est soumise au Règlement 2019/2088 du 27 novembre 2019 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers (dit « Règlement Disclosure »).

Ce Règlement établit des règles harmonisées pour les acteurs des marchés financiers relatives à la transparence en ce qui concerne l'intégration des risques en matière de durabilité (article 6 du Règlement), la prise en compte des incidences négatives en matière de durabilité, la promotion des caractéristiques environnementales ou sociales dans le processus d'investissement (article 8 du Règlement) ou les objectifs d'investissement durable (article 9 du Règlement).

Le risque en matière de durabilité est défini comme un événement ou une situation dans le domaine environnemental, social ou de la gouvernance qui, s'il survient, pourrait avoir une incidence négative importante, réelle ou potentielle, sur la valeur de l'investissement.

# SG LIQUIDITE PEA

L'investissement durable correspond à un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental, mesuré par exemple au moyen d'indicateurs clés en matière d'utilisation efficace des ressources concernant l'utilisation d'énergie, d'énergies renouvelables, de matières premières, d'eau et de terres, en matière de production de déchets et d'émissions de gaz à effet de serre ou en matière d'effets sur la biodiversité et l'économie circulaire, ou un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif social, en particulier un investissement qui contribue à la lutte contre les inégalités ou qui favorise la cohésion sociale, l'intégration sociale et les relations de travail, ou un investissement dans le capital humain ou des communautés économiquement ou socialement défavorisées, pour autant que ces investissements ne causent de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquels les investissements sont réalisés appliquent des pratiques de bonne gouvernance, en particulier en ce qui concerne des structures de gestion saines, les relations avec le personnel, la rémunération du personnel compétent et le respect des obligations fiscales. "

## **- Modification dans la note détaillée :**

### Avant :

#### "1. Stratégies utilisées

De par son éligibilité au PEA, le fonds détiendra en permanence au moins 75% de son actif en titres éligibles au PEA. Ces titres seront sélectionnés selon une méthode ou une combinaison des méthodes suivantes en fonction du couple coût / tracking error de chacune de ces méthodes :

une réplique pure d'un indice sur lequel existe des produits dérivés liquides et remplissant la contrainte d'éligibilité au PEA (CAC40, EuroStoxx50, ...). Afin de réaliser son objectif de gestion d'un placement monétaire, cette partie titres sera couverte par l'utilisation de produits dérivés sur l'indice concerné;

la constitution d'un portefeuille optimisé de titres remplissant la contrainte d'éligibilité au PEA. Afin de réaliser son objectif de gestion d'un placement monétaire, ce portefeuille titres sera couvert par un swap de performance permettant d'échanger la performance du portefeuille de titres contre la performance d'un placement monétaire. En fonction des conditions de marché cette méthode peut permettre de minimiser les coûts de frottement engendrés par une réplique pure et d'offrir une performance encore plus proche de celle de l'indice de référence ainsi qu'une tracking error plus faible.

L'investisseur est averti qu'il existe un risque action résiduel du fait de la stratégie d'investissement du fonds. "

Date de mise à jour du prospectus :28 août 2020

### Après :

#### "1. Stratégies utilisées :

De par son éligibilité au PEA, le fonds détiendra en permanence au moins 75% de son actif en titres éligibles au PEA. Ces titres seront sélectionnés selon une méthode ou une combinaison des méthodes suivantes en fonction du couple coût / tracking error de chacune de ces méthodes :

une réplique pure d'un indice sur lequel existe des produits dérivés liquides et remplissant la contrainte d'éligibilité au PEA (CAC40, EuroStoxx50, ...). Afin de réaliser son objectif de gestion d'un placement monétaire, cette partie titres sera couverte par l'utilisation de produits dérivés sur l'indice concerné;

la constitution d'un portefeuille optimisé de titres remplissant la contrainte d'éligibilité au PEA. Afin de réaliser son objectif de gestion d'un placement monétaire, ce portefeuille titres sera couvert par un swap de performance permettant d'échanger la performance du portefeuille de titres contre la performance d'un placement monétaire. En fonction des conditions de marché cette méthode peut permettre de minimiser les coûts de frottement engendrés par une réplique pure et d'offrir une performance encore plus proche de celle de l'indice de référence ainsi qu'une tracking error plus faible.

L'investisseur est averti qu'il existe un risque action résiduel du fait de la stratégie d'investissement du fonds. "

Date de mise à jour du prospectus :11 février 2021

## **- Modification du règlement :**

### Avant :

Date de la mise à jour du règlement :28 août 2020

### Après :

Date de la mise à jour du règlement :11 février 2021

# SG LIQUIDITE PEA

## Rapport d'activité

### Mars 2021

Sur la période, le fonds a affiché une performance nette annualisée de -0.43% contre -0.47% pour son indice de référence, EONIA Capitalisé.

Le portefeuille est constitué de plus de 75% d'actions de la Communauté Européenne garantissant l'éligibilité au PEA de l'OPCVM. Afin d'obtenir une performance proche du monétaire, la performance de ce panier d'actions est échangée contre une performance monétaire via un contrat d'échange (swap). Les résultats en termes de gestion du fonds sont liés aux évolutions du taux du marché monétaire, à savoir à l'Eonia.

De mars 2020 à mars 2021, la performance du portefeuille « SG LIQUIDITE PEA » est de -0,42%. Celle du benchmark est de -0,47% avec une tracking error de 0,03%.

### Information sur les incidences liées à la crise Covid-19

La crise sanitaire du Covid-19 n'a pas eu de conséquences significatives sur l'OPC au cours de l'exercice.

*La performance obtenue sur la période ne préjuge pas des résultats futurs du Fonds.*

### Principaux mouvements dans le portefeuille au cours de l'exercice

Titres	Mouvements ("Devise de comptabilité")	
	Acquisitions	Cessions
AMUNDI SERENITE PEA O FCP	43 998 151,08	61 707 291,92

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

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

# SG LIQUIDITE PEA

## Informations spécifiques

### Proportion d'investissement de l'actif en titres ou droits éligible au PEA

La société de gestion assure un suivi quotidien du niveau de détention de titres éligibles au régime fiscal PEA afin de s'assurer que le portefeuille est en permanence investi de manière à respecter le seuil minimal exigé par la réglementation.

- La documentation juridique du Fonds prévoit qu'il est investi en totalité et en permanence en parts (ou actions le cas échéant) de son OPC maître et indique, au titre des frais indirects, les taux maxima des commissions de souscription et de rachat, ainsi que des frais de gestion de cet OPC maître.

Conformément à la réglementation et au cours de la période écoulée, l'OPC maître a présenté en pratique des taux conformes à ceux mentionnés dans la notice d'information et repris dans le paragraphe « Frais de gestion ».

### Fonds et instruments du groupe

- Cette information est présentée dans l'Annexe aux Comptes annuels - Compléments d'information relatif au Bilan et au Compte de résultat. (Autres informations).

### Calcul du risque global

#### • Méthode du calcul de l'engagement

Les contrats à terme fermes sont portés pour leur valeur de marché, en engagement hors bilan, au cours de compensation. Les opérations à terme conditionnelles sont traduites en équivalent sous-jacent. Les contrats d'échange de taux réalisés de gré à gré sont évalués sur la base du montant nominal, plus ou moins, la différence d'estimation correspondante.

### Droit de vote

Le FCP étant nourricier (c'est-à-dire investi en totalité et en permanence en parts d'un seul OPC maître, et à titre accessoire en liquidités), c'est la politique de vote de son fonds maître qu'il convient de considérer.

Vous pouvez vous reporter à cette politique et au rapport d'exercice des droits de vote relatif sur le site internet de la société de gestion : [www.amundi.com](http://www.amundi.com), rubrique « à propos de Amundi ».

# SG LIQUIDITE PEA

## Informations réglementaires

### Procédure de sélection de brokers et des contreparties

Les intermédiaires sont sélectionnés en fonction des critères suivants :

- Le risque de contrepartie défini par l'équipe d'analyse crédit de la Société de gestion sur la base d'une étude interne extrêmement détaillée. Cette analyse est menée séparément sur le marché monétaire et sur le marché obligataire,
- La compétitivité des prix évaluée à partir d'un état de reporting fourni par les tables de négociation,
- La qualité de l'exécution et du dénouement des opérations évaluée par un état de reporting fourni par le middle office,
- La qualité de la recherche.
- La demande d'entrée en relation avec un nouvel intermédiaire financier, à l'initiative d'un négociateur ou d'un gérant, doit être présentée à la Direction des Risques de la Société de gestion pour accord.

Le document « politique d'exécution » est disponible sur le site internet de SOCIETE GENERALE GESTION : [www.societegeneralegestion.fr](http://www.societegeneralegestion.fr).

### Rapport sur les frais d'intermédiation

Le compte rendu relatif au frais d'intermédiation est disponible sur le site Internet de S2G [www.societegeneralegestion.fr](http://www.societegeneralegestion.fr) ou adressé à tout porteur qui en ferait la demande.

### Respect par l'OPC de critères relatifs aux objectifs environnementaux, sociaux et de qualité de gouvernance (ESG)

Dans l'ensemble de sa gestion active\*, Société Générale Gestion (S2G) applique des règles strictes d'intégration des critères extra-financiers (ESG) qui constituent le socle de sa responsabilité :

- Pas d'investissement direct dans les entreprises impliquées dans la fabrication ou le commerce des mines antipersonnel et des bombes à sous-munitions prohibées par les conventions d'Ottawa et d'Oslo
- Exclusion des entreprises produisant ou commercialisant des armes chimiques, des armes biologiques et des armes à l'uranium appauvri
- Exclusion des entreprises contrevenant gravement et de manière répétée à l'un ou plusieurs des dix principes du Pacte Mondial

Par ailleurs, au cours de l'année 2017, S2G a pris la décision de se désengager des entreprises réalisant plus de 30% de leur chiffre d'affaires dans l'extraction du charbon, ou, suite à une analyse qualitative et prospective, de certaines sociétés produisant 100 millions de tonnes et plus de charbon par an.

Ces émetteurs sont notés G sur l'échelle de S2G (échelle de A à G, A étant la meilleure note et G la moins bonne). Des informations complémentaires sur les modalités de prise en compte des critères ESG par Société Générale Gestion sont disponibles sur son site Internet : [www.societegeneralegestion.fr](http://www.societegeneralegestion.fr).

\* Gestion active : hors OPC indicieux et ETF contraints par leur indice de référence

### Politique de rémunérations

#### 1. Politique et pratiques de rémunération du personnel du gestionnaire

La politique de rémunération mise en place au sein de Société Générale Gestion est conforme aux dispositions en matière de rémunération mentionnées dans la directive 2011/61/UE du Parlement Européen et du Conseil du 8 juin 2011 sur les gestionnaires de fonds d'investissement alternatifs (ci-après la « Directive AIFM »), et dans la directive 2014/91/UE du 23 juillet 2014 concernant les OPCVM (ci-après la « Directive UCITS V »). Ces règles, portant sur les structures, les pratiques et la politique de rémunération du gestionnaire ont notamment pour but de contribuer à renforcer la gestion saine, efficace et maîtrisée des risques pesant tant sur la société de gestion que sur les fonds gérés.

Cette politique s'inscrit dans le cadre de la politique de rémunération du Groupe Amundi, revue chaque année par son Comité des Rémunérations. Lors de la séance du 4 février 2020, celui-ci a vérifié l'application de la politique applicable au titre de l'exercice 2019 et sa conformité avec les principes des Directives AIFM et UCITS V et a approuvé la politique applicable au titre de l'exercice 2020.

# SG LIQUIDITE PEA

La mise en œuvre de la politique de rémunération Amundi a fait l'objet, courant 2020, d'une évaluation interne, centrale et indépendante, conduite par l'Audit Interne Amundi.

## 1.1 Montant des rémunérations versées par le gestionnaire à son personnel

Sur l'exercice 2020, le montant total des rémunérations (incluant les rémunérations fixes et variable différées et non différées) versées par Société Générale Gestion à l'ensemble de son personnel (soit 84 collaborateurs au 31 décembre 2020) s'est élevé à 7 075 004 euros. Ce montant se décompose comme suit :

- Montant total des rémunérations fixes versées par Société Générale Gestion sur l'exercice : 5 406 310 euros, soit 76% du total des rémunérations versées par le gestionnaire à l'ensemble de son personnel, l'ont été sous la forme de rémunération fixe.
- Montant total des rémunérations variables différées et non différées versées par Société Générale Gestion sur l'exercice : 1 668 694 euros, soit 24% du total des rémunérations versées par le gestionnaire à l'ensemble de son personnel, l'ont été sous cette forme. L'ensemble du personnel est éligible au dispositif de rémunération variable.

Par ailleurs, aucun « carried interest » n'a été versé pour l'exercice.

Du fait du nombre réduit de « cadres dirigeants et cadres supérieurs » (3 collaborateurs au 31 décembre 2020) et de « gérants décisionnaires » dont les activités ont une incidence significative sur le profil de risque des fonds gérés (1 collaborateur au 31 décembre 2020), le montant total des rémunérations (fixes et variables différés et non différés) versées à ces catégories de personnel n'est pas publié.

## 1.2 Incidences de la politique et des pratiques de rémunération sur le profil de risque et sur la gestion des conflits d'intérêt

Le Groupe Amundi s'est doté d'une politique et a mis en œuvre des pratiques de rémunération conformes aux dernières évolutions législatives, réglementaires et doctrinales issues des autorités de régulation pour l'ensemble de ses Sociétés de Gestion.

Le Groupe Amundi a également procédé à l'identification de son Personnel Identifié qui comprend l'ensemble des collaborateurs du Groupe Amundi exerçant un pouvoir de décision sur la gestion des sociétés ou des fonds gérés et susceptibles par conséquent d'avoir un impact significatif sur la performance ou le profil de risque.

Les rémunérations variables attribuées au personnel du Groupe Amundi sont déterminées en combinant l'évaluation des performances du collaborateur concerné, de l'unité opérationnelle auquel il appartient et des résultats d'ensemble du Groupe. Cette évaluation des performances individuelles prend en compte aussi bien des critères financiers que non financiers, ainsi que le respect des règles de saine gestion des risques.

Les critères pris en compte pour l'évaluation des performances et l'attribution des rémunérations variables dépendent de la nature de la fonction exercée :

### 1. Fonctions de sélection et de gestion de portefeuille

Critères financiers usuels :

- Performances brute et nette du fonds géré sur 1, 3 ans ;
- Ratio d'information et ratio de Sharpe sur 1, 3 et 5 ans ;
- Performance fees générées pendant l'exercice si pertinent ;
- Classements concurrentiels ;
- Contribution à la collecte nette réalisée sur l'exercice.

Critères non-financiers usuels :

- Respect des règles internes en matière de prévention et de gestion des risques (Risques/Conformité) ;
- Innovation / développement produit ;
- Transversalité, partage des best practices et collaboration ;
- Contribution à l'engagement commercial ;
- Qualité du management.

### 2. Fonctions commerciales

Critères financiers usuels :

- Collecte nette ;
- Recettes ;

# SG LIQUIDITE PEA

- Collecte brute; développement et fidélisation de la clientèle; gamme de produits ;

Critères non-financiers usuels :

- Prise en compte conjointe des intérêts d'Amundi et du client ;
- Satisfaction client et qualité de la relation commerciale ;
- Qualité du management ;
- Sécurisation/développement du fonds de commerce ;
- Transversalité et partage des best practices ;
- Esprit d'entreprise.

### 3. Fonctions de support et de contrôle

En ce qui concerne les fonctions de contrôle, l'évaluation de la performance et les attributions de rémunération variable sont indépendantes de la performance des secteurs d'activités qu'elles contrôlent.

Les critères habituellement pris en compte sont les suivants :

- Principalement des critères liés à l'atteinte d'objectifs qui leur sont propres (maîtrise des risques, qualité des contrôles, réalisation de projets, amélioration des outils et systèmes etc.)
- Lorsque des critères financiers sont utilisés, ils tournent essentiellement autour de la gestion et l'optimisation des charges.

Les critères de performance ci-dessus énoncés, et notamment ceux appliqués au Personnel Identifié en charge de la gestion, s'inscrivent plus largement dans le respect de la réglementation applicable aux fonds gérés ainsi que de la politique d'investissement du comité d'investissement du gestionnaire.

En outre, le Groupe Amundi a mis en place, pour l'ensemble de son personnel, des mesures visant à aligner les rémunérations sur la performance et les risques à long terme, et à limiter les risques de conflits d'intérêts.

A ce titre, notamment,

- La mise en place d'un barème de différé, conforme aux exigences des Directives AIFM et UCITS V.
- La partie différée du bonus des collaborateurs du Personnel Identifié est versée en instruments indexés à 100% sur la performance d'un panier de fonds représentatif.
- L'acquisition définitive de la partie différée est liée à la situation financière d'Amundi, à la continuité d'emploi du collaborateur dans le groupe ainsi qu'à sa gestion saine et maîtrisée des risques sur toute la période d'acquisition.

# SG LIQUIDITE PEA

## Techniques de gestion efficace du portefeuille et instruments financiers dérivés

Néant.





## **Indépendance**

Nous avons réalisé notre mission d'audit dans le respect des règles d'indépendance prévues par le code de commerce et par le code de déontologie de la profession de commissaire aux comptes, sur la période du 1<sup>er</sup> avril 2020 à la date d'émission de notre rapport.

## **Justification des appréciations**

La crise mondiale liée à la pandémie de COVID-19 crée des conditions particulières pour la préparation et l'audit des comptes de cet exercice. En effet, cette crise et les mesures exceptionnelles prises dans le cadre de l'état d'urgence sanitaire induisent de multiples conséquences pour les fonds, leurs investissements et l'évaluation des actifs et passifs correspondants. Certaines de ces mesures, telles que les restrictions de déplacement et le travail à distance, ont également eu une incidence sur la gestion opérationnelle des fonds et sur les modalités de mise en œuvre des audits.

C'est dans ce contexte complexe et évolutif que, en application des dispositions des articles L. 823-9 et R. 823-7 du code de commerce relatives à la justification de nos appréciations, nous vous informons que les appréciations les plus importantes auxquelles nous avons procédé, selon notre jugement professionnel, ont porté sur le caractère approprié des principes comptables appliqués, notamment pour ce qui concerne les instruments financiers en portefeuille et sur la présentation d'ensemble des comptes, au regard du plan comptable des organismes de placement collectif à capital variable.

Les appréciations ainsi portées s'inscrivent dans le contexte de l'audit des comptes annuels pris dans leur ensemble et de la formation de notre opinion exprimée ci-avant. Nous n'exprimons pas d'opinion sur des éléments de ces comptes annuels pris isolément.

## **Vérifications spécifiques**

Nous avons également procédé, conformément aux normes d'exercice professionnel applicables en France, aux vérifications spécifiques prévues par les textes légaux et réglementaires.

Nous n'avons pas d'observation à formuler sur la sincérité et la concordance avec les comptes annuels des informations données dans le rapport de gestion établi par la société de gestion.

## **Responsabilités de la société de gestion relatives aux comptes annuels**

Il appartient à la société de gestion d'établir des comptes annuels présentant une image fidèle conformément aux règles et principes comptables français ainsi que de mettre en place le contrôle interne qu'elle estime nécessaire à l'établissement de comptes annuels ne comportant pas d'anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs.

Lors de l'établissement des comptes annuels, il incombe à la société de gestion d'évaluer la capacité du FCP à poursuivre son exploitation, de présenter dans ces comptes, le cas échéant, les informations nécessaires relatives à la continuité d'exploitation et d'appliquer la convention comptable de continuité d'exploitation, sauf s'il est prévu de liquider le FCP ou de cesser son activité.

Les comptes annuels ont été établis par la société de gestion.



## **Responsabilités du commissaire aux comptes relatives à l'audit des comptes annuels**

Il nous appartient d'établir un rapport sur les comptes annuels. Notre objectif est d'obtenir l'assurance raisonnable que les comptes annuels pris dans leur ensemble ne comportent pas d'anomalies significatives. L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, sans toutefois garantir qu'un audit réalisé conformément aux normes d'exercice professionnel permet de systématiquement détecter toute anomalie significative. Les anomalies peuvent provenir de fraudes ou résulter d'erreurs et sont considérées comme significatives lorsque l'on peut raisonnablement s'attendre à ce qu'elles puissent, prises individuellement ou en cumulé, influencer les décisions économiques que les utilisateurs des comptes prennent en se fondant sur ceux-ci.

Comme précisé par l'article L.823-10-1 du code de commerce, notre mission de certification des comptes ne consiste pas à garantir la viabilité ou la qualité de la gestion de votre FCP.

Dans le cadre d'un audit réalisé conformément aux normes d'exercice professionnel applicables en France, le commissaire aux comptes exerce son jugement professionnel tout au long de cet audit. En outre:

- il identifie et évalue les risques que les comptes annuels comportent des anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs, définit et met en œuvre des procédures d'audit face à ces risques, et recueille des éléments qu'il estime suffisants et appropriés pour fonder son opinion. Le risque de non-détection d'une anomalie significative provenant d'une fraude est plus élevé que celui d'une anomalie significative résultant d'une erreur, car la fraude peut impliquer la collusion, la falsification, les omissions volontaires, les fausses déclarations ou le contournement du contrôle interne ;
- il prend connaissance du contrôle interne pertinent pour l'audit afin de définir des procédures d'audit appropriées en la circonstance, et non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne ;
- il apprécie le caractère approprié des méthodes comptables retenues et le caractère raisonnable des estimations comptables faites par la société de gestion, ainsi que les informations les concernant fournies dans les comptes annuels;
- il apprécie le caractère approprié de l'application par la société de gestion de la convention comptable de continuité d'exploitation et, selon les éléments collectés, l'existence ou non d'une incertitude significative liée à des événements ou à des circonstances susceptibles de mettre en cause la capacité du FCP à poursuivre son exploitation. Cette appréciation s'appuie sur les éléments collectés jusqu'à la date de son rapport, étant toutefois rappelé que des circonstances ou événements ultérieurs pourraient mettre en cause la continuité d'exploitation. S'il conclut à l'existence d'une incertitude significative, il attire l'attention des lecteurs de son rapport sur les informations fournies dans les comptes annuels au sujet de cette incertitude ou, si ces informations ne sont pas fournies ou ne sont pas pertinentes, il formule une certification avec réserve ou un refus de certifier;



- il apprécie la présentation d'ensemble des comptes annuels et évalue si les comptes annuels reflètent les opérations et événements sous-jacents de manière à en donner une image fidèle.

Paris La Défense, le 10 juin 2021

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés

*Stéphane Collas*  
Stéphane COLLAS

*Jean-Marc LECAT*  
Jean-Marc LECAT

# Comptes annuels

# SG LIQUIDITE PEA

## BILAN Actif

	31.03.2021	31.03.2020
Devise	EUR	EUR
<b>Instruments financiers</b>	<b>99 753 920,53</b>	<b>117 684 958,64</b>
• OPC MAÎTRE	99 753 920,53	117 684 958,64
• CONTRATS FINANCIERS	-	-
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	-	-
Autres opérations	-	-
<b>Créances</b>	<b>29 863,02</b>	<b>139 760,60</b>
Opérations de change à terme de devises	-	-
Autres	29 863,02	139 760,60
<b>Comptes financiers</b>	<b>928 412,91</b>	-
Liquidités	928 412,91	-
<b>Total de l'actif</b>	<b>100 712 196,46</b>	<b>117 824 719,24</b>

# SG LIQUIDITE PEA

## BILAN Passif

	31.03.2021	31.03.2020
Devise	EUR	EUR
<b>Capitaux propres</b>		
• Capital	100 221 777,39	118 022 121,17
• Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées	-	-
• Report à nouveau	-	-
• Plus et moins-values nettes de l'exercice	-239 414,13	-125 805,02
• Résultat de l'exercice	-222 180,18	-263 628,72
<b>Total des capitaux propres</b> <i>(montant représentatif de l'actif net)</i>	<b>99 760 183,08</b>	<b>117 632 687,43</b>
<b>Instruments financiers</b>	-	-
• <b>CONTRATS FINANCIERS</b>		
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	-	-
Autres opérations	-	-
<b>Dettes</b>	<b>952 013,38</b>	<b>108 773,67</b>
Opérations de change à terme de devises	-	-
Autres	952 013,38	108 773,67
<b>Comptes financiers</b>	-	<b>83 258,14</b>
Concours bancaires courants	-	83 258,14
Emprunts	-	-
<b>Total du passif</b>	<b>100 712 196,46</b>	<b>117 824 719,24</b>

# SG LIQUIDITE PEA

## HORS-BILAN

31.03.2021

31.03.2020

Devise	EUR	EUR
<b>Opérations de couverture</b>		
• Engagements sur marchés réglementés ou assimilés		
- Marché à terme ferme (Futures)	-	-
- Marché à terme conditionnel (Options)	-	-
- Dérivés de crédit	-	-
- Swaps	-	-
- Contracts for Differences (CFD)	-	-
• Engagements de gré à gré		
- Marché à terme ferme (Futures)	-	-
- Marché à terme conditionnel (Options)	-	-
- Dérivés de crédit	-	-
- Swaps	-	-
- Contracts for Differences (CFD)	-	-
• Autres engagements		
- Marché à terme ferme (Futures)	-	-
- Marché à terme conditionnel (Options)	-	-
- Dérivés de crédit	-	-
- Swaps	-	-
- Contracts for Differences (CFD)	-	-
<b>Autres opérations</b>		
• Engagements sur marchés réglementés ou assimilés		
- Marché à terme ferme (Futures)	-	-
- Marché à terme conditionnel (Options)	-	-
- Dérivés de crédit	-	-
- Swaps	-	-
- Contracts for Differences (CFD)	-	-
• Engagements de gré à gré		
- Marché à terme ferme (Futures)	-	-
- Marché à terme conditionnel (Options)	-	-
- Dérivés de crédit	-	-
- Swaps	-	-
- Contracts for Differences (CFD)	-	-
• Autres engagements		
- Marché à terme ferme (Futures)	-	-
- Marché à terme conditionnel (Options)	-	-
- Dérivés de crédit	-	-
- Swaps	-	-
- Contracts for Differences (CFD)	-	-

# SG LIQUIDITE PEA

## COMPTE DE RÉSULTAT

	31.03.2021	31.03.2020
Devise	EUR	EUR
<b>Produits sur opérations financières</b>		
• Produits sur dépôts et sur comptes financiers	0,63	-
• Produits sur actions et valeurs assimilées	-	-
• Produits sur obligations et valeurs assimilées	-	-
• Produits sur titres de créances	-	-
• Produits sur acquisitions et cessions temporaires de titres financiers	-	-
• Produits sur contrats financiers	-	-
• Autres produits financiers	-	-
<b>Total (I)</b>	<b>0,63</b>	<b>-</b>
<b>Charges sur opérations financières</b>		
• Charges sur acquisitions et cessions temporaires de titres financiers	-	-
• Charges sur contrats financiers	-	-
• Charges sur dettes financières	-3 203,60	-2 915,16
• Autres charges financières	-	-837,41
<b>Total (II)</b>	<b>-3 203,60</b>	<b>-3 752,57</b>
<b>Résultat sur opérations financières (I - II)</b>	<b>-3 202,97</b>	<b>-3 752,57</b>
Autres produits (III)	-	-
Frais de gestion et dotations aux amortissements (IV)	-236 092,08	-240 222,04
<b>Résultat net de l'exercice (L.214-17-1) (I - II + III - IV)</b>	<b>-239 295,05</b>	<b>-243 974,61</b>
Régularisation des revenus de l'exercice (V)	17 114,87	-19 654,11
Acomptes sur résultat versés au titre de l'exercice (VI)	-	-
<b>Résultat (I - II + III - IV +/- V - VI) :</b>	<b>-222 180,18</b>	<b>-263 628,72</b>

## 1 Règles & méthodes comptables

Les comptes annuels sont présentés sous la forme prévue par le règlement ANC n° 2014-01, modifié.

### Information sur les incidences liées à la crise Covid-19

Les comptes ont été établis par la société de gestion sur la base des éléments disponibles dans un contexte évolutif de crise liée au Covid-19.

### Règles d'évaluation et de comptabilisation des actifs

Les actions, obligations et valeurs assimilées de la zone Euro sont valorisées sur la base des cours de clôture.

Les actions, obligations et valeurs assimilées hors zone Euro sont valorisées sur la base des derniers cours connus, convertis en devise de comptabilité suivant le taux de change à Paris le jour de l'évaluation.

Les valeurs mobilières dont le cours n'a pas été constaté le jour de l'évaluation ou dont le cours a été corrigé sont évaluées à leur valeur probable de négociation par le gérant. Dans le cas des ABS et MBS, ces évaluations sont obtenues par une interrogation systématique du marché pour chaque titre concerné. Ces évaluations sont communiquées au commissaire aux comptes à l'occasion de ses contrôles.

Les positions ouvertes sur les marchés à terme fermes de la zone Euro sont évaluées au cours de compensation.

Les positions ouvertes sur les marchés à terme conditionnels de la zone Euro sont évaluées au cours de clôture du jour.

Les positions ouvertes sur les marchés à terme fermes et conditionnels hors zone Euro sont évaluées sur la base des derniers cours connus, convertis en devise de comptabilité suivant le taux de change du jour.

Les parts ou actions d'OPC sont évaluées à la dernière valeur liquidative connue.

Les parts de FCC, FCPR ou FCPI détenues sont évaluées à la dernière valeur liquidative connue.

Les titres de créances négociables et assimilés, qui font l'objet de transactions significatives, sont évalués par application d'une méthode actuarielle, le taux retenu étant celui des émissions de titres équivalents affecté, le cas échéant, d'un écart représentatif des caractéristiques intrinsèques de l'émetteur du titre. Toutefois, en l'absence de sensibilité particulière, les titres de créances d'une durée de vie résiduelle inférieure à 3 mois sont évalués selon une méthode linéaire.

Les titres reçus en pension sont inscrits en compte à leur date d'acquisition, pour la valeur fixée au contrat. Pendant la durée de détention des titres, ils sont maintenus à cette valeur augmentée des intérêts courus à recevoir.

Les titres donnés en pension sont sortis du portefeuille au jour de l'opération de pension et la créance correspondante est inscrite à l'actif du bilan, permettant une évaluation boursière des titres. La dette représentative des titres donnés en pension est affectée au passif du bilan à la valeur fixée au contrat augmentée des intérêts courus à payer.

Les titres empruntés sont évalués à leur valeur boursière. La dette représentative des titres empruntés est également évaluée à la valeur boursière augmentée des intérêts courus de l'emprunt.

Les titres prêtés sont sortis du portefeuille au jour du prêt, et la créance correspondante est inscrite à l'actif du bilan pour leur valeur de marché, augmentée des intérêts courus du prêt.

Les contrats d'échange de taux d'intérêts, de devises et corridors sont valorisés à leur valeur de marché par une méthode d'actualisation des flux de trésorerie futurs (principal et intérêts) au taux d'intérêt et/ou de devises du marché. Cette valorisation peut être corrigée du risque de signature. Les intérêts des contrats d'échange de taux et de devises d'une durée inférieure ou égale à 3 mois, sont linéarisés sur la durée restante à courir selon une méthode linéaire.

Les contrats d'échange de performance actions, d'OPC et d'indices sont valorisés à leur valeur de marché par une méthode d'actualisation des flux de trésorerie futurs. Cette valorisation peut être corrigée du risque de signature.

Les produits structurés crédit, change, taux (option sur spread, exotique, barrière, digitale sur défaut,...), les CDO et CSO, sont valorisés en fonction de paramètres de marché fournis par les contreparties et/ou en fonction des prix calculés par les contreparties sous le contrôle et la responsabilité de la société de gestion.

Les titres adossés à un contrat d'échange (asset swaps) sont évalués à prix de marché.

Les créances, dettes et disponibilités libellées en devises sont réévaluées aux taux de change du jour connus à Paris.

Les dépôts à terme rémunérés sont évalués sur la base des caractéristiques de l'opération définies lors de la négociation.

# SG LIQUIDITE PEA

Les options sur différence de taux CAP, FLOOR ou COLLAR sont valorisées selon une méthode actuarielle. Dans le cas d'options d'une durée de vie inférieure ou égale à 3 mois, les primes payées ou reçues sont lissées sur la durée restante à courir.

Les fonds d'investissement étrangers à valeur liquidative mensuelle sont valorisés sur la base de cours estimés fournis par le gérant. Ces évaluations sont communiquées au commissaire aux comptes à l'occasion de ses contrôles. Les dérivés de crédit sont valorisés chaque jour avec le module CDSW de bloomberg qui donne la valeur Mark-to Market une fois entrés tous les périmètres de l'instrument et le spread du jour obtenu de contributeurs de marché.

## Méthodes de comptabilisation

Les intérêts sont comptabilisés selon la méthode du coupon encaissé.

Les entrées en portefeuille sont comptabilisées à leur prix d'acquisition frais exclus, et les sorties à leur prix de cession frais exclus.

La commission de gestion est calculée périodiquement sur la base de l'actif net OPC inclus.

Les frais fixes sont provisionnés dans les comptes sur la base de la dernière facture connue ou du budget annoncé. En cas d'écart de provisions, un ajustement est opéré au paiement effectif des frais.

## Méthodes d'évaluation des engagements hors-bilan

Les opérations de hors-bilan sont évaluées à la valeur d'engagement.

La valeur d'engagement pour les contrats à terme fermes est égale au cours (en devise de l'opc) multiplié par le nombre de contrats multiplié par le nominal.

La valeur d'engagement pour les opérations conditionnelles est égale au cours du titre sous-jacent (en devise de l'opc) multiplié par le nombre de contrats multiplié par le delta multiplié par le nominal du sous-jacent.

La valeur d'engagement pour les contrats d'échange est égale au montant nominal du contrat (en devise de l'opc).

## Frais de fonctionnement et de gestion

Ces frais recouvrent tous les frais facturés directement à l'OPCVM, à l'exception des frais de transaction. Les frais de transaction incluent les frais d'intermédiation (courtage, impôts de bourse, etc.) et la commission de mouvement, le cas échéant, qui peut être perçue notamment par le dépositaire et la société de gestion.

Aux frais de fonctionnement et de gestion peuvent s'ajouter :

- des commissions de sur performance. Celles-ci rémunèrent la société de gestion dès lors que l'OPCVM a dépassé ses objectifs. Elles sont donc facturées à l'OPCVM ;
- des commissions de mouvements facturées à l'OPCVM ;
- des frais liés aux opérations d'acquisition et cession temporaires de titres.

## Frais de fonctionnement et de gestion de l'OPCVM nourricier

Frais facturés à l'OPCVM	Assiette	Taux barème
Frais de gestion financière	Actif net	0,75 % TTC maximum
Frais administratifs externes à la société de gestion		
Frais indirects maximum (commissions et frais de gestion)	Actif net	1.2 % TTC maximum
Commission de mouvement	Néant	Néant
Commission de surperformance	Néant	Néant

# SG LIQUIDITE PEA

Les frais de gestion maximum cumulés (frais directs du fonds nourricier et frais indirects du fonds maître) du nourricier sont plafonnés à 1,25%.

Pourront s'ajouter aux frais facturés à l'OPCVM et affichés ci-dessus, les coûts suivants : Les coûts juridiques exceptionnels liés au recouvrement des créances de l'OPCVM ;

Les coûts liés aux contributions dues par la société de gestion à l'AMF au titre de la gestion de l'OPCVM. Les frais de fonctionnement et de gestion sont directement imputés au compte de résultat de l'OPCVM.

En outre, en tant que fonds nourricier, le fonds supporte indirectement les frais suivants facturés à l'OPCVM maître :

## - Rappel des frais de gestion et de fonctionnement de l'OPCVM maître :

Frais facturés à l'OPCVM	Assiette	Taux barème
Frais de gestion financière	Actif net	Part I-C : 0,50 % TTC maximum
		Part I-D : 0,50 % TTC maximum
Frais administratifs externes à la société de gestion		Part O-C : 1,20 % TTC maximum
		Part P-C : 1,20 % TTC maximum
Frais indirects maximum (commissions et frais de gestion)	Actif net	Néant
Commission de mouvement  Perçue par le dépositaire  Perçue par la société de gestion sur les opérations de change et par Amundi Intermédiation sur tous les autres instruments et opérations.	Prélèvement sur chaque transaction ou opération	Montant forfaitaire de 0 à 113 euros TTC selon la place
		Montant forfaitaire de 1€ par contrat (futures/options) + commission proportionnelle de 0 à 0,10% selon les instruments (titres, change, ...)
Commission de surperformance	Néant	Part I-C : Néant
		Part I-D : Néant
		Part O-C : Néant
		Part P-C : Néant

### Devise de comptabilité

La devise de comptabilité est l'euro.

### Indication des changements comptables soumis à l'information particulière des porteurs

- Changement intervenu : Néant.
- Changement à intervenir : Néant.

### Indication et justification des changements d'estimation et de modalités d'application

Néant.

### Indication de la nature des erreurs corrigées au cours de l'exercice

Néant.

### Indication des droits et conditions attachés à chaque catégorie de parts

Affectation du résultat net : Capitalisation

Affectation des plus-values nettes réalisées : Capitalisation

## 2 Évolution actif net

Devise	31.03.2021	31.03.2020
	EUR	EUR
<b>Actif net en début d'exercice</b>	<b>117 632 687,43</b>	<b>104 225 344,17</b>
Souscriptions (y compris la commission de souscription acquise à l'Opc)	61 415 182,81	86 282 282,17
Rachats (sous déduction de la commission de rachat acquise à l'Opc)	-78 826 494,84	-72 258 773,06
Plus-values réalisées sur dépôts et instruments financiers	-	-
Moins-values réalisées sur dépôts et instruments financiers	-258 018,82	-115 932,96
Plus-values réalisées sur contrats financiers	-	-
Moins-values réalisées sur contrats financiers	-	-
Frais de transaction	-	-
Différences de change	-	-
Variations de la différence d'estimation des dépôts et instruments financiers :	36 121,55	-256 258,28
- Différence d'estimation exercice N	-458 271,79	-494 393,34
- Différence d'estimation exercice N-1	-494 393,34	-238 135,06
Variations de la différence d'estimation des contrats financiers :	-	-
- Différence d'estimation exercice N	-	-
- Différence d'estimation exercice N-1	-	-
Distribution de l'exercice antérieur sur plus et moins-values nettes	-	-
Distribution de l'exercice antérieur sur résultat	-	-
Résultat net de l'exercice avant compte de régularisation	-239 295,05	-243 974,61
Acompte(s) versé(s) au cours de l'exercice sur plus et moins-values nettes	-	-
Acompte(s) versé(s) au cours de l'exercice sur résultat	-	-
Autres éléments	-	-
<b>Actif net en fin d'exercice</b>	<b>99 760 183,08</b>	<b>117 632 687,43</b>

## 3 Compléments d'information

### 3.1. Instruments financiers : ventilation par nature juridique ou économique d'instrument

Ventilation des rubriques de hors-bilan par type de marché (notamment taux, actions)

	Taux	Actions	Change	Autres
<b>Opérations de couverture</b>				
Engagements sur les marchés réglementés ou assimilés	-	-	-	-
Engagements de gré à gré	-	-	-	-
Autres engagements	-	-	-	-
<b>Autres opérations</b>				
Engagements sur les marchés réglementés ou assimilés	-	-	-	-
Engagements de gré à gré	-	-	-	-
Autres engagements	-	-	-	-

### 3.2. Ventilation par nature de taux des postes d'actif et de hors-bilan

	Taux fixe	Taux variables	Taux révisable	Autres
<b>Actif</b>	-	-	-	-
Opérations temporaires sur titres financiers	-	-	-	-
Comptes financiers	-	-	-	-
<b>Hors-bilan</b>				
Opérations de couverture	-	-	-	-
Autres opérations	-	-	-	-

### 3.3. Ventilation par maturité résiduelle des postes d'actif et de hors-bilan

	0 - 3 mois	3 mois - 1 an	1 - 3 ans	3 - 5 ans	> 5 ans
<b>Actif</b>	-	-	-	-	-
Opérations temporaires sur titres financiers	-	-	-	-	-
Comptes financiers	-	-	-	-	-
<b>Hors-bilan</b>					
Opérations de couverture	-	-	-	-	-
Autres opérations	-	-	-	-	-

# SG LIQUIDITE PEA

## 3.4. Ventilation par devise de cotation ou d'évaluation des postes d'actif, de passif et de hors-bilan

Cette ventilation est donnée pour les principales devises de cotation ou d'évaluation, à l'exception de la devise de tenue de la comptabilité.

Par devise principale	-	-	-	Autres devises
<b>Actif</b>				
Opc Maître	-	-	-	-
Opérations temporaires sur titres financiers	-	-	-	-
Créances	-	-	-	-
Comptes financiers	-	-	-	-
Autres actifs	-	-	-	-
<b>Passif</b>				
Dettes	-	-	-	-
Comptes financiers	-	-	-	-
<b>Hors-bilan</b>				
Opérations de couverture	-	-	-	-
Autres opérations	-	-	-	-

## 3.5. Créances et Dettes : ventilation par nature

Détail des éléments constitutifs des postes "autres créances" et "autres dettes", notamment ventilation des opérations de change à terme par nature d'opération (achat/vente).

<b>Créances</b>		<b>29 863,02</b>
Opérations de change à terme de devises :		
Achats à terme de devises		-
Montant total négocié des Ventes à terme de devises		-
Autres Créances :		
Somme a payer		29 863,02
-		-
-		-
-		-
-		-
Autres opérations		-
<b>Dettes</b>		<b>952 013,38</b>
Opérations de change à terme de devises :		
Ventes à terme de devises		-
Montant total négocié des Achats à terme de devises		-
Autres Dettes :		
Achats reglements differes		928 439,90
Frais provisionnes		20 297,18
Somme a payer		3 276,30
-		-
-		-
Autres opérations		-

# SG LIQUIDITE PEA

## 3.6. Capitaux propres

	Souscriptions		Rachats	
	Nombre de parts	Montant	Nombre de parts	Montant
Nombre de parts émises / rachetées pendant l'exercice	3 888,19078	61 415 182,81	4 990,35971	78 826 494,84
Commission de souscription / rachat		-		-
Rétrocessions		-		-
Commissions acquises à l'Opc		-		-

## 3.7. Frais de gestion

Frais de fonctionnement et de gestion (frais fixes) en % de l'actif net moyen	<b>0,22</b>
Commission de surperformance (frais variables) : montant des frais de l'exercice	-
Rétrocession de frais de gestion :	
- Montant des frais rétrocédés à l'Opc	-
- Ventilation par Opc "cible" :	
- Opc 1	-
- Opc 2	-

## 3.8. Engagements reçus et donnés

3.8.1. Description des garanties reçues par l'Opc avec mention des garanties de capital .....	<b>néant</b>
3.8.2. Description des autres engagements reçus et/ou donnés .....	<b>néant</b>

# SG LIQUIDITE PEA

## 3.9. Autres informations

3.9.1. Valeur actuelle des instruments financiers faisant l'objet d'une acquisition temporaire :

- Instruments financiers reçus en pension (livrée)	-
- Autres opérations temporaires	-

3.9.2. Valeur actuelle des instruments financiers constitutifs de dépôts de garantie :

Instruments financiers reçus en garantie et non inscrits au bilan :

- actions	-
- obligations	-
- titres de créances	-
- autres instruments financiers	-

Instruments financiers donnés en garantie et maintenus dans leur poste d'origine :

- actions	-
- obligations	-
- titres de créances	-
- autres instruments financiers	-

3.9.3. Instruments financiers détenus en portefeuille émis par les entités liées à la société de gestion (fonds) ou aux gestionnaires financiers (Sicav) et opc gérés par ces entités :

- opc	<b>99 753 920,53</b>
- autres instruments financiers	-

# SG LIQUIDITE PEA

## 3.10. Tableau d'affectation du résultat (En devise de comptabilité de l'Opc)

### Acomptes versés au titre de l'exercice

Date	Montant global	Montant unitaire	Crédit d'impôt totaux	Crédit d'impôt unitaire
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
<b>Total acomptes</b>	-	-	-	-

	31.03.2021	31.03.2020
<b>Affectation du résultat</b>	EUR	EUR
<b>Sommes restant à affecter</b>		
Report à nouveau	-	-
Résultat	-222 180,18	-263 628,72
<b>Total</b>	<b>-222 180,18</b>	<b>-263 628,72</b>
<b>Affectation</b>		
Distribution	-	-
Report à nouveau de l'exercice	-	-
Capitalisation	-222 180,18	-263 628,72
<b>Total</b>	<b>-222 180,18</b>	<b>-263 628,72</b>
<b>Information relative aux parts ouvrant droit à distribution</b>		
Nombre de parts	-	-
Distribution unitaire	-	-
<b>Crédits d'impôt attaché à la distribution du résultat</b>	-	-

# SG LIQUIDITE PEA

## 3.11. Tableau d'affectation des sommes distribuables afférentes aux plus et moins-values nettes (En devise de comptabilité de l'Opc)

### Acomptes sur plus et moins-values nettes versés au titre de l'exercice

Date	Montant global	Montant unitaire
-	-	-
-	-	-
-	-	-
-	-	-
<b>Total acomptes</b>	-	-

	31.03.2021	31.03.2020
<b>Affectation des plus et moins-values nettes</b>	EUR	EUR
<b>Sommes restant à affecter</b>		
Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées	-	-
Plus et moins-values nettes de l'exercice	-239 414,13	-125 805,02
Acomptes versés sur plus et moins-values nettes de l'exercice	-	-
<b>Total</b>	<b>-239 414,13</b>	<b>-125 805,02</b>
<b>Affectation</b>		
Distribution	-	-
Plus et moins-values nettes non distribuées	-	-
Capitalisation	-239 414,13	-125 805,02
<b>Total</b>	<b>-239 414,13</b>	<b>-125 805,02</b>
<b>Information relative aux parts ouvrant droit à distribution</b>		
Nombre de parts	-	-
Distribution unitaire	-	-

# SG LIQUIDITE PEA

## 3.12. Tableau des résultats et autres éléments caractéristiques du FCP au cours des 5 derniers exercices

Devise EUR	31.03.2021	31.03.2020	29.03.2019	29.03.2018	31.03.2017
<b>Actif net</b>	<b>99 760 183,08</b>	117 632 687,43	104 225 344,17	93 226 749,37	102 908 194,88
<b>Nombre de parts en circulation</b>	<b>6 330,99127</b>	7 433,1602	6 549,737	5 836,05293	6 416,40948
<b>Valeur liquidative</b>	<b>15 757,43</b>	15 825,39	15 912,9	15 974,28	16 038,28
<b>Distribution unitaire sur plus et moins-values nettes (y compris acomptes)</b>	-	-	-	-	-
<b>Distribution unitaire (y compris acomptes)</b>	-	-	-	-	-
<b>Crédit d'impôt unitaire transféré aux porteurs (personne physique) <sup>(1)</sup></b>	-	-	-	-	-
<b>Capitalisation unitaire <sup>(2)</sup></b>	<b>-72,91</b>	-52,39	-45,80	-40,38	-27,88

<sup>(1)</sup> En application de l'Instruction Fiscale du 4 mars 1993 de la Direction Générale des Impôts, le crédit d'impôt unitaire est déterminé le jour du détachement du dividende par répartition du montant global des crédits d'impôt entre les parts en circulation à cette date.

<sup>(2)</sup> La capitalisation unitaire correspond à la somme du résultat et des plus et moins-values nettes sur le nombre de parts en circulation. Cette méthode de calcul est appliquée depuis le 1er janvier 2013.

Date de création du Fonds : 14 octobre 2002.

# SG LIQUIDITE PEA

## 4 Inventaire au 31.03.2021

Code valeur	Libellé valeur	Statut Valeur	Quantité	Valeur boursière	Devise de cotation	% Actif net
<b>Valeurs mobilières</b>						
<b>O.P.C.V.M.</b>						
FR0011636158	AMUNDI SERENITE PEA O FCP	PROPRE	1 003 350,612	99 753 920,53	EUR	99,99
<b>Total O.P.C.V.M.</b>				<b>99 753 920,53</b>		<b>99,99</b>
<b>Total Valeurs mobilières</b>				<b>99 753 920,53</b>		<b>99,99</b>
<b>Liquidités</b>						
<b>BANQUE OU ATTENTE</b>						
	ACH DIFF TITRES EUR	PROPRE	-928 439,90	-928 439,90	EUR	-0,93
	BANQUE EUR SGP	PROPRE	928 412,91	928 412,91	EUR	0,93
<b>Total BANQUE OU ATTENTE</b>				<b>-26,99</b>		<b>-0,00</b>
<b>FRAIS DE GESTION</b>						
	PRCOMGESTADM	PROPRE	-911,82	-911,82	EUR	-0,00
	PRCOMGESTDEP	PROPRE	-923,54	-923,54	EUR	-0,00
	PRCOMGESTFIN	PROPRE	-17 817,92	-17 817,92	EUR	-0,02
	PRHONOCAC	PROPRE	-643,90	-643,90	EUR	-0,00
	PRN-1COMGESTADM	PROPRE	-1 627,65	-1 627,65	EUR	-0,00
	PRN-1COMGESTDEP	PROPRE	-1 648,65	-1 648,65	EUR	-0,00
	PRRETROFDGN-1	PROPRE	29 863,02	29 863,02	EUR	0,03
<b>Total FRAIS DE GESTION</b>				<b>6 289,54</b>		<b>0,01</b>
<b>Total Liquidités</b>				<b>6 262,55</b>		<b>0,01</b>
<b>Total SG LIQUIDITE PEA</b>				<b>99 760 183,08</b>		<b>100,00</b>

## **Société Générale Gestion**

Société Anonyme au capital de 567 034 094 euros

Société de Gestion de Portefeuille agréée par l'AMF n° GP 09000020

Siège social : 90, boulevard Pasteur 75015 Paris - France - 491 910 691 RCS Paris

**Comptes annuels au 31.03.2021  
du Fonds maître  
AMUNDI SERENITE PEA**

## AMUNDI SERENITE PEA

Fonds Commun de Placement

Société de Gestion :  
Amundi Asset Management

90, boulevard Pasteur  
75015 PARIS

### Rapport du Commissaire aux Comptes sur les comptes annuels

Exercice clos le 31 mars 2021

---

Aux porteurs de parts du FCP AMUNDI SERENITE PEA,

#### Opinion

En exécution de la mission qui nous a été confiée par la société de gestion, nous avons effectué l'audit des comptes annuels de l'organisme de placement collectif AMUNDI SERENITE PEA constitué sous forme de fonds commun de placement (FCP) relatifs à l'exercice clos le 31 mars 2021, tels qu'ils sont joints au présent rapport.

Nous certifions que les comptes annuels sont, au regard des règles et principes comptables français, réguliers et sincères et donnent une image fidèle du résultat des opérations de l'exercice écoulé ainsi que de la situation financière et du patrimoine du FCP, à la fin de cet exercice.

#### Fondement de l'opinion sur les comptes annuels

##### Référentiel d'audit

Nous avons effectué notre audit selon les normes d'exercice professionnel applicables en France. Nous estimons que les éléments que nous avons collectés sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion.

Les responsabilités qui nous incombent en vertu de ces normes sont indiquées dans la partie « Responsabilités du commissaire aux comptes relatives à l'audit des comptes annuels » du présent rapport.

## **Indépendance**

Nous avons réalisé notre mission d'audit dans le respect des règles d'indépendance prévues par le code de commerce et par le code de déontologie de la profession de commissaire aux comptes, sur la période du 1 avril 2020 à la date d'émission de notre rapport.

## **Justification des appréciations**

La crise mondiale liée à la pandémie de COVID-19 crée des conditions particulières pour la préparation et l'audit des comptes de cet exercice. En effet, cette crise et les mesures exceptionnelles prises dans le cadre de l'état d'urgence sanitaire induisent de multiples conséquences pour les fonds, leurs investissements et l'évaluation des actifs et passifs correspondants. Certaines de ces mesures, telles que les restrictions de déplacement et le travail à distance, ont également eu une incidence sur la gestion opérationnelle des fonds et sur les modalités de mise en œuvre des audits.

C'est dans ce contexte complexe et évolutif que, en application des dispositions des articles L. 823-9 et R. 823-7 du code de commerce relatives à la justification de nos appréciations, nous vous informons que les appréciations les plus importantes auxquelles nous avons procédé, selon notre jugement professionnel, ont porté sur le caractère approprié des principes comptables appliqués, notamment pour ce qui concerne les instruments financiers en portefeuille et sur la présentation d'ensemble des comptes, au regard du plan comptable des organismes de placement collectif à capital variable.

Les appréciations ainsi portées s'inscrivent dans le contexte de l'audit des comptes annuels pris dans leur ensemble et de la formation de notre opinion exprimée ci-avant. Nous n'exprimons pas d'opinion sur des éléments de ces comptes annuels pris isolément.

## **Vérifications spécifiques**

Nous avons également procédé, conformément aux normes d'exercice professionnel applicables en France, aux vérifications spécifiques prévues par les textes légaux et réglementaires.

Nous n'avons pas d'observation à formuler sur la sincérité et la concordance avec les comptes annuels des informations données dans le rapport de gestion établi par la société de gestion.

## **Responsabilités de la société de gestion relatives aux comptes annuels**

Il appartient à la société de gestion d'établir des comptes annuels présentant une image fidèle conformément aux règles et principes comptables français ainsi que de mettre en place le contrôle interne qu'elle estime nécessaire à l'établissement de comptes annuels ne comportant pas d'anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs.

Lors de l'établissement des comptes annuels, il incombe à la société de gestion d'évaluer la capacité du FCP à poursuivre son exploitation, de présenter dans ces comptes, le cas échéant, les informations nécessaires relatives à la continuité d'exploitation et d'appliquer la convention comptable de continuité d'exploitation, sauf s'il est prévu de liquider le FCP ou de cesser son activité.

Les comptes annuels ont été établis par la société de gestion.

## **Responsabilités du commissaire aux comptes relatives à l'audit des comptes annuels**

Il nous appartient d'établir un rapport sur les comptes annuels. Notre objectif est d'obtenir l'assurance raisonnable que les comptes annuels pris dans leur ensemble ne comportent pas d'anomalies significatives. L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, sans toutefois garantir qu'un audit réalisé conformément aux normes d'exercice professionnel permet de systématiquement détecter toute anomalie significative. Les anomalies peuvent provenir de fraudes ou résulter d'erreurs et sont considérées comme significatives lorsque l'on peut raisonnablement s'attendre à ce qu'elles puissent, prises individuellement ou en cumulé, influencer les décisions économiques que les utilisateurs des comptes prennent en se fondant sur ceux-ci.

Comme précisé par l'article L.823-10-1 du code de commerce, notre mission de certification des comptes ne consiste pas à garantir la viabilité ou la qualité de la gestion de votre FCP.

Dans le cadre d'un audit réalisé conformément aux normes d'exercice professionnel applicables en France, le commissaire aux comptes exerce son jugement professionnel tout au long de cet audit. En outre :

- Il identifie et évalue les risques que les comptes annuels comportent des anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs, définit et met en œuvre des procédures d'audit face à ces risques, et recueille des éléments qu'il estime suffisants et appropriés pour fonder son opinion. Le risque de non-détection d'une anomalie significative provenant d'une fraude est plus élevé que celui d'une anomalie significative résultant d'une erreur, car la fraude peut impliquer la collusion, la falsification, les omissions volontaires, les fausses déclarations ou le contournement du contrôle interne ;
- Il prend connaissance du contrôle interne pertinent pour l'audit afin de définir des procédures d'audit appropriées en la circonstance, et non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne ;
- Il apprécie le caractère approprié des méthodes comptables retenues et le caractère raisonnable des estimations comptables faites par la société de gestion, ainsi que les informations les concernant fournies dans les comptes annuels ;
- Il apprécie le caractère approprié de l'application par la société de gestion de la convention comptable de continuité d'exploitation et, selon les éléments collectés, l'existence ou non d'une incertitude significative liée à des événements ou à des circonstances susceptibles de mettre en cause la capacité du FCP à poursuivre son exploitation. Cette appréciation s'appuie sur les éléments collectés jusqu'à la date de son rapport, étant toutefois rappelé que des circonstances ou événements ultérieurs pourraient mettre en cause la continuité d'exploitation. S'il conclut à l'existence d'une incertitude significative, il attire l'attention des lecteurs de son rapport sur les informations fournies dans les comptes annuels au sujet de cette incertitude ou, si ces informations ne sont pas fournies ou ne sont pas pertinentes, il formule une certification avec réserve ou un refus de certifier ;

- il apprécie la présentation d'ensemble des comptes annuels et évalue si les comptes annuels reflètent les opérations et événements sous-jacents de manière à en donner une image fidèle.

Paris La Défense, le 11 juin 2021

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés

*Stéphane Collas*  
Stéphane COLLAS

# **AMUNDI SERENITE PEA**

**COMPTES ANNUELS**  
**31/03/2021**

## BILAN ACTIF AU 31/03/2021 EN EUR

	31/03/2021	31/03/2020
<b>IMMOBILISATIONS NETTES</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>DÉPÔTS</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>INSTRUMENTS FINANCIERS</b>	<b>1 933 367 229,81</b>	<b>1 948 875 259,89</b>
<b>Actions et valeurs assimilées</b>	<b>1 573 439 358,37</b>	<b>1 685 032 878,45</b>
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	1 573 439 358,37	1 685 032 878,45
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
<b>Obligations et valeurs assimilées</b>	<b>132 667 079,13</b>	<b>208 291 840,27</b>
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	132 667 079,13	208 291 840,27
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
<b>Titres de créances</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
Négoiciés sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Titres de créances négociables	0,00	0,00
Autres titres de créances	0,00	0,00
Non négoiciés sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
<b>Organismes de placement collectif</b>	<b>1 121 784,04</b>	<b>12 133 088,79</b>
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	1 121 784,04	12 133 088,79
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE	0,00	0,00
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés	0,00	0,00
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés	0,00	0,00
Autres organismes non européens	0,00	0,00
<b>Opérations temporaires sur titres</b>	<b>225 521 828,32</b>	<b>22 990 928,23</b>
Créances représentatives de titres reçus en pension	0,00	0,00
Créances représentatives de titres prêtés	225 521 828,32	22 990 928,23
Titres empruntés	0,00	0,00
Titres donnés en pension	0,00	0,00
Autres opérations temporaires	0,00	0,00
<b>Instruments financiers à terme</b>	<b>617 179,95</b>	<b>20 508 935,75</b>
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	2 160,00	72 380,00
Autres opérations	615 019,95	20 436 555,75
<b>Autres instruments financiers</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>CRÉANCES</b>	<b>45 784 644,08</b>	<b>54 751 200,88</b>
Opérations de change à terme de devises	0,00	0,00
Autres	45 784 644,08	54 751 200,88
<b>COMPTES FINANCIERS</b>	<b>164 980 653,92</b>	<b>18 867 497,54</b>
Liquidités	164 980 653,92	18 867 497,54
<b>TOTAL DE L'ACTIF</b>	<b>2 144 132 527,81</b>	<b>2 022 576 369,91</b>

## BILAN PASSIF AU 31/03/2021 EN EUR

	31/03/2021	31/03/2020
<b>CAPITAUX PROPRES</b>		
Capital	2 336 945 414,76	1 476 055 489,58
Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées (a)	2 777 108,62	1 136 121,11
Report à nouveau (a)	13,34	38,46
Plus et moins-values nettes de l'exercice (a,b)	-552 355 293,15	363 845 007,08
Résultat de l'exercice (a,b)	37 430 584,30	93 520 924,35
<b>TOTAL DES CAPITAUX PROPRES *</b>	<b>1 824 797 827,87</b>	<b>1 934 557 580,58</b>
<i>* Montant représentatif de l'actif net</i>		
<b>INSTRUMENTS FINANCIERS</b>	<b>143 670 138,08</b>	<b>51 794 566,90</b>
Opérations de cession sur instruments financiers	0,00	0,00
Opérations temporaires sur titres	90 883 653,83	4 494 279,49
Dettes représentatives de titres donnés en pension	0,00	0,00
Dettes représentatives de titres empruntés	-204,47	91,12
Autres opérations temporaires	90 883 858,30	4 494 188,37
Instrument financiers à terme	52 786 484,25	47 300 287,41
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	2 160,00	72 380,00
Autres opérations	52 784 324,25	47 227 907,41
<b>DETTES</b>	<b>167 633 299,62</b>	<b>30 050 169,06</b>
Opérations de change à terme de devises	0,00	0,00
Autres	167 633 299,62	30 050 169,06
<b>COMPTES FINANCIERS</b>	<b>8 031 262,24</b>	<b>6 174 053,37</b>
Concours bancaires courants	8 031 262,24	6 174 053,37
Emprunts	0,00	0,00
<b>TOTAL DU PASSIF</b>	<b>2 144 132 527,81</b>	<b>2 022 576 369,91</b>

(a) Y compris comptes de régularisation

(b) Diminués des acomptes versés au titre de l'exercice

## HORS-BILAN AU 31/03/2021 EN EUR

	31/03/2021	31/03/2020
<b>OPÉRATIONS DE COUVERTURE</b>		
Engagement sur marchés réglementés ou assimilés		
Contrats futures		
XEUR FGBS SCH 0620	0,00	34 554 520,00
XEUR FGBS SCH 0621	48 427 200,00	0,00
Engagement sur marché de gré à gré		
Swaps de performance		
BNP PARIBAS	155 000 025,93	0,00
BANK OF AMERICA SECU	170 000 025,00	0,00
GOLDMAN SACHS	0,00	100 000 013,77
GOLDMAN SACHS	250 000 000,00	249 999 989,77
GOLDMAN SACHS	100 000 000,00	0,00
GOLDMAN SACHS	110 000 000,00	0,00
GOLDMAN SACHS	100 000 000,00	0,00
JP MORGAN	400 000 002,75	0,00
JP MORGAN	249 999 999,33	0,00
SOCIETE GENERALE	125 000 047,33	0,00
Autres engagements		
<b>AUTRES OPÉRATIONS</b>		
Engagement sur marchés réglementés ou assimilés		
Engagement sur marché de gré à gré		
Swaps de performance		
BARCLAYS 24/05/19	0,00	205 698 099,22
BANK OF AMERICA SECU	0,00	200 000 017,40
GOLDMAN SACHS	0,00	100 000 003,73
GOLDMAN SACHS	0,00	80 000 001,21
JP MORGAN	0,00	399 999 988,62
JP MORGAN	0,00	250 000 000,30
SOCIETE GENERALE	0,00	100 000 060,56
Autres engagements		

## COMPTE DE RÉSULTAT AU 31/03/2021 EN EUR

	31/03/2021	31/03/2020
<b>Produits sur opérations financières</b>		
Produits sur dépôts et sur comptes financiers	298 803,73	440 868,36
Produits sur actions et valeurs assimilées	46 149 708,68	97 473 431,16
Produits sur obligations et valeurs assimilées	894 702,80	1 393 134,78
Produits sur titres de créances	0,00	0,00
Produits sur acquisitions et cessions temporaires de titres	283 777,25	334 168,63
Produits sur instruments financiers à terme	0,00	0,00
Autres produits financiers	0,00	0,00
<b>TOTAL (1)</b>	<b>47 626 992,46</b>	<b>99 641 602,93</b>
<b>Charges sur opérations financières</b>		
Charges sur acquisitions et cessions temporaires de titres	352 191,11	457 487,97
Charges sur instruments financiers à terme	0,00	247 249,34
Charges sur dettes financières	498 094,84	803 691,08
Autres charges financières	0,00	0,00
<b>TOTAL (2)</b>	<b>850 285,95</b>	<b>1 508 428,39</b>
<b>RÉSULTAT SUR OPÉRATIONS FINANCIÈRES (1 - 2)</b>	<b>46 776 706,51</b>	<b>98 133 174,54</b>
Autres produits (3)	0,00	0,00
Frais de gestion et dotations aux amortissements (4)	4 529 464,86	2 447 201,32
<b>RÉSULTAT NET DE L'EXERCICE (L. 214-17-1) (1 - 2 + 3 - 4)</b>	<b>42 247 241,65</b>	<b>95 685 973,22</b>
Régularisation des revenus de l'exercice (5)	-4 816 657,35	-2 165 048,87
Acomptes sur résultat versés au titre de l'exercice (6)	0,00	0,00
<b>RÉSULTAT (1 - 2 + 3 - 4 + 5 - 6)</b>	<b>37 430 584,30</b>	<b>93 520 924,35</b>

# ANNEXES AUX COMPTES ANNUELS

## 1. Règles et méthodes comptables

Les comptes annuels sont présentés sous la forme prévue par le règlement ANC n° 2014-01, modifié.

Les principes généraux de la comptabilité s'appliquent :

- image fidèle, comparabilité, continuité de l'activité,
- régularité, sincérité,
- prudence,
- permanence des méthodes d'un exercice à l'autre.

Le mode de comptabilisation retenu pour l'enregistrement des produits des titres à revenu fixe est celui des intérêts encaissés.

Les entrées et les cessions de titres sont comptabilisées frais exclus.

La devise de référence de la comptabilité du portefeuille est en euro.

La durée de l'exercice est de 12 mois.

### Information sur les incidences liées à la crise du COVID-19

Les comptes ont été établis par la société de gestion sur la base des éléments disponibles dans un contexte évolutif de crise liée au Covid-19.

### Règles d'évaluation des actifs

Les instruments financiers sont enregistrés en comptabilité selon la méthode des coûts historiques et inscrits au bilan à leur valeur actuelle qui est déterminée par la dernière valeur de marché connue ou à défaut d'existence de marché par tous moyens externes ou par recours à des modèles financiers.

Les différences entre les valeurs actuelles utilisées lors du calcul de la valeur liquidative et les coûts historiques des valeurs mobilières à leur entrée en portefeuille sont enregistrées dans des comptes « différences d'estimation ».

Les valeurs qui ne sont pas dans la devise du portefeuille sont évaluées conformément au principe énoncé ci-dessous, puis converties dans la devise du portefeuille suivant le cours des devises au jour de l'évaluation.

#### **Dépôts :**

Les dépôts d'une durée de vie résiduelle inférieure ou égale à 3 mois sont valorisés selon la méthode linéaire.

#### **Actions, obligations et autres valeurs négociées sur un marché réglementé ou assimilé :**

Pour le calcul de la valeur liquidative, les actions et autres valeurs négociées sur un marché réglementé ou assimilé sont évaluées sur la base du dernier cours de bourse du jour.

Les obligations et valeurs assimilées sont évaluées au cours de clôture communiqués par différents prestataires de services financiers. Les intérêts courus des obligations et valeurs assimilées sont calculés jusqu'à la date de la valeur liquidative.

#### **Actions, obligations et autres valeurs non négociées sur un marché réglementé ou assimilé :**

Les valeurs non négociées sur un marché réglementé sont évaluées sous la responsabilité de la société de gestion en utilisant des méthodes fondées sur la valeur patrimoniale et le rendement, en prenant en considération les prix retenus lors de transactions significatives récentes.

#### **Titres de créances négociables :**

Les Titres de Créances Négociables et assimilés qui ne font pas l'objet de transactions significatives sont évalués de façon actuarielle sur la base d'un taux de référence défini ci-dessous, majoré le cas échéant d'un écart représentatif des caractéristiques intrinsèques de l'émetteur :

- TCN dont l'échéance est inférieure ou égale à 1 an : Taux interbancaire offert en euros (Euribor) ;
- TCN dont l'échéance est supérieure à 1 an : Taux des Bons du Trésor à intérêts Annuels Normalisés (BTAN) ou taux de l'OAT (Obligations Assimilables du Trésor) de maturité proche pour les durées les plus longues.

Les Titres de Créances Négociables d'une durée de vie résiduelle inférieure ou égale à 3 mois pourront être évalués selon la méthode linéaire.

Les Bons du Trésor sont valorisés au taux du marché communiqué quotidiennement par la Banque de France ou les spécialistes des bons du Trésor.

#### ***OPC détenus :***

Les parts ou actions d'OPC seront valorisées à la dernière valeur liquidative connue.

#### ***Opérations temporaires sur titres :***

Les titres reçus en pension sont inscrits à l'actif dans la rubrique « créances représentatives des titres reçus en pension » pour le montant prévu dans le contrat, majoré des intérêts courus à recevoir.

Les titres donnés en pension sont inscrits en portefeuille acheteur pour leur valeur actuelle. La dette représentative des titres donnés en pension est inscrite en portefeuille vendeur à la valeur fixée au contrat majorée des intérêts courus à payer.

Les titres prêtés sont valorisés à leur valeur actuelle et sont inscrits à l'actif dans la rubrique « créances représentatives de titres prêtés » à la valeur actuelle majorée des intérêts courus à recevoir.

Les titres empruntés sont inscrits à l'actif dans la rubrique « titres empruntés » pour le montant prévu dans le contrat, et au passif dans la rubrique « dettes représentatives de titres empruntés » pour le montant prévu dans le contrat majoré des intérêts courus à payer.

#### ***Instruments financiers à terme :***

##### **Instruments financiers à terme négociés sur un marché réglementé ou assimilé :**

Les instruments financiers à terme négociés sur les marchés réglementés sont valorisés au cours de compensation du jour.

##### **Instruments financiers à terme non négociés sur un marché réglementé ou assimilé :**

##### ***Les Swaps :***

Les contrats d'échange de taux d'intérêt et/ou de devises sont valorisés à leur valeur de marché en fonction du prix calculé par actualisation des flux d'intérêts futurs aux taux d'intérêts et/ou de devises de marché. Ce prix est corrigé du risque de signature.

Les swaps d'indice sont évalués de façon actuarielle sur la base d'un taux de référence fourni par la contrepartie.

Les autres swaps sont évalués à leur valeur de marché ou à une valeur estimée selon les modalités arrêtées par la société de gestion.

##### ***Engagements Hors Bilan :***

Les contrats à terme ferme sont portés pour leur valeur de marché en engagements hors bilan au cours utilisé dans le portefeuille.

Les opérations à terme conditionnelles sont traduites en équivalent sous-jacent.

Les engagements sur contrats d'échange sont présentés à leur valeur nominale, ou en l'absence de valeur nominale pour un montant équivalent.

#### **Frais de gestion**

Les frais de gestion et de fonctionnement recouvrent l'ensemble des frais relatif à l'OPC : gestion financière, administrative, comptable, conservation, distribution, frais d'audit...

Ces frais sont imputés au compte de résultat de l'OPC.

Les frais de gestion n'incluent pas les frais de transaction. Pour plus de précision sur les frais effectivement facturés à l'OPC, se reporter au prospectus.

Ils sont enregistrés au prorata temporis à chaque calcul de valeur liquidative.

Le cumul de ces frais respecte le taux de frais maximum de l'actif net indiqué dans le prospectus ou le règlement du fonds :

FR0010179671 - AMUNDI SERENITE PEA PEA I-D : Taux de frais maximum de 0.50% TTC.

FR0011636158 - AMUNDI SERENITE PEA PEA O-C : Taux de frais maximum de 1.20% TTC.

FR0011408350 - AMUNDI SERENITE PEA PEA P-C : Taux de frais maximum de 1.20% TTC.

FR0010173237 - AMUNDI SERENITE PEA PEA I-C : Taux de frais maximum de 0.50% TTC.

### **Affectation des sommes distribuables**

#### **Définition des sommes distribuables**

Les sommes distribuables sont constituées par :

#### **Le résultat :**

Le résultat net de l'exercice est égal au montant des intérêts, arrérages, primes et lots, dividendes, jetons de présence et tous autres produits relatifs aux titres constituant le portefeuille, majorés du produit des sommes momentanément disponibles et diminué du montant des frais de gestion et de la charge des emprunts.

Il est augmenté du report à nouveau et majoré ou diminué du solde du compte de régularisation des revenus.

#### **Les Plus et Moins-values :**

Les plus-values réalisées, nettes de frais, diminuées des moins-values réalisées, nettes de frais, constatées au cours de l'exercice, augmentées des plus-values nettes de même nature constatées au cours d'exercices antérieurs n'ayant pas fait l'objet d'une distribution ou d'une capitalisation et diminuées ou augmentées du solde du compte de régularisation des plus-values.

#### **Modalités d'affectation des sommes distribuables :**

<b>Part(s)</b>	<b>Affectation du résultat net</b>	<b>Affectation des plus ou moins-values nettes réalisées</b>
Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA I-C	Capitalisation	Capitalisation
Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA I-D	Distribution	Capitalisation, et/ou Distribution par décision de la société de gestion
Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA O-C	Capitalisation	Capitalisation
Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA P-C	Capitalisation	Capitalisation

## 2. ÉVOLUTION DE L'ACTIF NET AU 31/03/2021 EN EUR

	31/03/2021	31/03/2020
<b>ACTIF NET EN DÉBUT D'EXERCICE</b>	<b>1 934 557 580,58</b>	<b>1 886 902 548,51</b>
Souscriptions (y compris les commissions de souscriptions acquises à l'OPC)	1 515 873 824,00	1 919 309 021,51
Rachats (sous déduction des commissions de rachat acquises à l'OPC)	-1 617 613 487,96	-1 863 019 745,76
Plus-values réalisées sur dépôts et instruments financiers	204 567 569,52	140 442 201,66
Moins-values réalisées sur dépôts et instruments financiers	-158 193 381,36	-46 315 252,79
Plus-values réalisées sur instruments financiers à terme	225 358 018,70	726 303 152,94
Moins-values réalisées sur instruments financiers à terme	-873 211 722,98	-436 805 630,84
Frais de transactions	-1 241 368,81	-2 932 720,48
Différences de change	-125 810,60	-63 642,43
Variations de la différence d'estimation des dépôts et instruments financiers	579 264 004,39	-483 344 552,09
<i>Différence d'estimation exercice N</i>	217 157 607,98	-362 106 396,41
<i>Différence d'estimation exercice N-1</i>	362 106 396,41	-121 238 155,68
Variations de la différence d'estimation des instruments financiers à terme	-25 448 172,64	-1 116 425,09
<i>Différence d'estimation exercice N</i>	-52 167 144,30	-26 718 971,66
<i>Différence d'estimation exercice N-1</i>	26 718 971,66	25 602 546,57
Distribution de l'exercice antérieur sur plus et moins-values nettes	0,00	0,00
Distribution de l'exercice antérieur sur résultat	-1 236 466,62	-487 347,78
Résultat net de l'exercice avant compte de régularisation	42 247 241,65	95 685 973,22
Acompte(s) versé(s) au cours de l'exercice sur plus et moins-values nettes	0,00	0,00
Acompte(s) versé(s) au cours de l'exercice sur résultat	0,00	0,00
Autres éléments	0,00	0,00
<b>ACTIF NET EN FIN D'EXERCICE</b>	<b>1 824 797 827,87</b>	<b>1 934 557 580,58</b>

### 3. COMPLÉMENTS D'INFORMATION

#### 3.1. VENTILATION PAR NATURE JURIDIQUE OU ÉCONOMIQUE DES INSTRUMENTS FINANCIERS

	Montant	%
<b>ACTIF</b>		
<b>OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES</b>		
Obligations à taux VAR / REV négociées sur un marché réglementé ou assimilé	9 571 215,93	0,52
Obligations à taux fixe négociées sur un marché réglementé ou assimilé	123 095 863,20	6,75
<b>TOTAL OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES</b>	<b>132 667 079,13</b>	<b>7,27</b>
<b>TITRES DE CRÉANCES</b>		
<b>TOTAL TITRES DE CRÉANCES</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>PASSIF</b>		
<b>OPÉRATIONS DE CESSION SUR INSTRUMENTS FINANCIERS</b>		
<b>TOTAL OPÉRATIONS DE CESSION SUR INSTRUMENTS FINANCIERS</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>HORS-BILAN</b>		
<b>OPÉRATIONS DE COUVERTURE</b>		
Taux	48 427 200,00	2,65
Autres	1 660 000 100,34	90,97
<b>TOTAL OPÉRATIONS DE COUVERTURE</b>	<b>1 708 427 300,34</b>	<b>93,62</b>
<b>AUTRES OPÉRATIONS</b>		
<b>TOTAL AUTRES OPÉRATIONS</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

### 3.2. VENTILATION PAR NATURE DE TAUX DES POSTES D'ACTIF, DE PASSIF ET DE HORS-BILAN

	Taux fixe	%	Taux variable	%	Taux révisable	%	Autres	%
<b>ACTIF</b>								
Dépôts	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Obligations et valeurs assimilées	123 095 863,20	6,75	0,00	0,00	9 571 215,93	0,52	0,00	0,00
Titres de créances	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Opérations temporaires sur titres	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Comptes financiers	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	164 980 653,92	9,04
<b>PASSIF</b>								
Opérations temporaires sur titres	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Comptes financiers	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	8 031 262,24	0,44
<b>HORS-BILAN</b>								
Opérations de couverture	48 427 200,00	2,65	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Autres opérations	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

### 3.3. VENTILATION PAR MATURITÉ RÉSIDUELLE DES POSTES D'ACTIF, DE PASSIF ET DE HORS-BILAN(\*)

	< 3 mois	%	]3 mois - 1 an]	%	]1 - 3 ans]	%	]3 - 5 ans]	%	> 5 ans	%
<b>ACTIF</b>										
Dépôts	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Obligations et valeurs assimilées	6 967 630,93	0,38	36 190 971,52	1,98	89 508 476,68	4,91	0,00	0,00	0,00	0,00
Titres de créances	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Opérations temporaires sur titres	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Comptes financiers	164 980 653,92	9,04	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>PASSIF</b>										
Opérations temporaires sur titres	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Comptes financiers	8 031 262,24	0,44	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>HORS-BILAN</b>										
Opérations de couverture	0,00	0,00	0,00	0,00	48 427 200,00	2,65	0,00	0,00	0,00	0,00
Autres opérations	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

(\*) Les positions à terme de taux sont présentées en fonction de l'échéance du sous-jacent.

### 3.4. VENTILATION PAR DEVISE DE COTATION OU D'ÉVALUATION DES POSTES D'ACTIF, DE PASSIF ET DE HORS-BILAN (HORS EUR)

	Devise 1 USD		Devise 2 GBP		Devise 3		Devise N Autre(s)	
	Montant	%	Montant	%	Montant	%	Montant	%
<b>ACTIF</b>								
Dépôts	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Actions et valeurs assimilées	0,00	0,00	687 650,41	0,04	0,00	0,00	0,00	0,00
Obligations et valeurs assimilées	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Titres de créances	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
OPC	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Opérations temporaires sur titres	40,42	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Créances	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Comptes financiers	895,92	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>PASSIF</b>								
Opérations de cession sur instruments financiers	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Opérations temporaires sur titres	0,00	0,00	687 650,41	0,04	0,00	0,00	0,00	0,00
Dettes	20,21	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Comptes financiers	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>HORS-BILAN</b>								
Opérations de couverture	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Autres opérations	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

### 3.5. CRÉANCES ET DETTES : VENTILATION PAR NATURE

	Nature de débit/crédit	31/03/2021
<b>CRÉANCES</b>		
	Dépôts de garantie en espèces	138 003,10
	Coupons et dividendes en espèces	2 916 640,98
	Collatéraux	42 730 000,00
<b>TOTAL DES CRÉANCES</b>		<b>45 784 644,08</b>
<b>DETTES</b>		
	Achats à règlement différé	658 947,96
	Frais de gestion fixe	549 136,66
	Collatéraux	166 389 758,00
	Autres dettes	35 457,00
<b>TOTAL DES DETTES</b>		<b>167 633 299,62</b>
<b>TOTAL DETTES ET CRÉANCES</b>		<b>-121 848 655,54</b>

### 3.6. CAPITAUX PROPRES

#### 3.6.1. Nombre de titres émis ou rachetés

	En parts	En montant
<b>Part AMUNDI SERENITE PEA PEA I-C</b>		
Parts souscrites durant l'exercice	106 510,634	1 178 053 694,76
Parts rachetées durant l'exercice	-102 345,605	-1 131 190 283,97
Solde net des souscriptions/rachats	4 165,029	46 863 410,79
Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	66 755,333	
<b>Part AMUNDI SERENITE PEA PEA I-D</b>		
Parts souscrites durant l'exercice	4 551,871	27 374 682,99
Parts rachetées durant l'exercice	-7 155,549	-42 784 504,99
Solde net des souscriptions/rachats	-2 603,678	-15 409 822,00
Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	1 974,132	
<b>Part AMUNDI SERENITE PEA PEA O-C</b>		
Parts souscrites durant l'exercice	3 011 064,456	299 782 931,87
Parts rachetées durant l'exercice	-4 358 557,140	-433 875 207,88
Solde net des souscriptions/rachats	-1 347 492,684	-134 092 276,01
Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	10 277 403,927	
<b>Part AMUNDI SERENITE PEA PEA P-C</b>		
Parts souscrites durant l'exercice	108 668,085	10 662 514,38
Parts rachetées durant l'exercice	-99 357,165	-9 763 491,12
Solde net des souscriptions/rachats	9 310,920	899 023,26
Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	564 647,814	

### 3.6.2. Commissions de souscription et/ou rachat

	En montant
<b>Part AMUNDI SERENITE PEA PEA I-C</b>	
Total des commissions de souscription et/ou rachat acquises	0,00
Commissions de souscription acquises	0,00
Commissions de rachat acquises	0,00
<b>Part AMUNDI SERENITE PEA PEA I-D</b>	
Total des commissions de souscription et/ou rachat acquises	0,00
Commissions de souscription acquises	0,00
Commissions de rachat acquises	0,00
<b>Part AMUNDI SERENITE PEA PEA O-C</b>	
Total des commissions de souscription et/ou rachat acquises	0,00
Commissions de souscription acquises	0,00
Commissions de rachat acquises	0,00
<b>Part AMUNDI SERENITE PEA PEA P-C</b>	
Total des commissions de souscription et/ou rachat acquises	0,00
Commissions de souscription acquises	0,00
Commissions de rachat acquises	0,00

### 3.7. FRAIS DE GESTION

	31/03/2021
<b>Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA I-C</b>	
Commissions de garantie	0,00
Frais de gestion fixes	3 165 016,92
Pourcentage de frais de gestion fixes	0,36
Frais de gestion variables	0,00
Rétrocessions des frais de gestion	0,00
<b>Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA I-D</b>	
Commissions de garantie	0,00
Frais de gestion fixes	67 993,06
Pourcentage de frais de gestion fixes	0,34
Frais de gestion variables	0,00
Rétrocessions des frais de gestion	0,00
<b>Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA O-C</b>	
Commissions de garantie	0,00
Frais de gestion fixes	1 096 154,23
Pourcentage de frais de gestion fixes	0,10
Frais de gestion variables	0,00
Rétrocessions des frais de gestion	0,00
<b>Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA P-C</b>	
Commissions de garantie	0,00
Frais de gestion fixes	200 300,65
Pourcentage de frais de gestion fixes	0,38
Frais de gestion variables	0,00
Rétrocessions des frais de gestion	0,00

### 3.8. ENGAGEMENTS REÇUS ET DONNÉS

#### 3.8.1. Garanties reçues par l'OPC :

Néant

#### 3.8.2. Autres engagements reçus et/ou donnés :

Néant

### 3.9. AUTRES INFORMATIONS

#### 3.9.1. Valeur actuelle des instruments financiers faisant l'objet d'une acquisition temporaire

	31/03/2021
Titres pris en pension livrée	0,00
Titres empruntés	0,00

#### 3.9.2. Valeur actuelle des instruments financiers constitutifs de dépôts de garantie

	31/03/2021
Instruments financiers donnés en garantie et maintenus dans leur poste d'origine	0,00
Instruments financiers reçus en garantie et non-inscrits au bilan	0,00

#### 3.9.3. Instruments financiers détenus, émis et/ou gérés par le Groupe

	Code ISIN	Libellé	31/03/2021
Actions			0,00
Obligations			0,00
TCN			0,00
OPC			1 121 784,04
	FR0007435920	AMUNDI CASH INSTITUTIONS SRI I	217 220,82
	FR0013412038	AMUNDI ETF PEA MSCI EUROPE UCITS ETF - EUR	897 923,95
	FR0007038138	AMUNDI EURO LIQUIDITY-RATED SRI I	1 046,07
	FR0000983751	AMUNDI TRESO COURT TERME I C	5 593,20
Instruments financiers à terme			0,00
<b>Total des titres du groupe</b>			<b>1 121 784,04</b>

### 3.10. TABLEAU D'AFFECTATION DES SOMMES DISTRIBUABLES

Tableau d'affectation de la quote-part des sommes distribuables afférente au résultat

	31/03/2021	31/03/2020
<b>Sommes restant à affecter</b>		
Report à nouveau	13,34	38,46
Résultat	37 430 584,30	93 520 924,35
<b>Total</b>	<b>37 430 597,64</b>	<b>93 520 962,81</b>

	31/03/2021	31/03/2020
<b>Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA I-C</b>		
<b>Affectation</b>		
Distribution	0,00	0,00
Report à nouveau de l'exercice	0,00	0,00
Capitalisation	14 051 763,17	32 750 573,16
<b>Total</b>	<b>14 051 763,17</b>	<b>32 750 573,16</b>

	31/03/2021	31/03/2020
<b>Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA I-D</b>		
<b>Affectation</b>		
Distribution	224 142,95	1 365 102,94
Report à nouveau de l'exercice	19,03	30,85
Capitalisation	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>224 161,98</b>	<b>1 365 133,79</b>
<b>Informations relatives aux parts ouvrant droit à distribution</b>		
Nombre de parts	1 974,132	4 577,810
Distribution unitaire	113,54	298,20
<b>Crédit d'impôt</b>		
Crédit d'impôt attachés à la distribution du résultat	0,00	6,19

	31/03/2021	31/03/2020
<b>Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA O-C</b>		
<b>Affectation</b>		
Distribution	0,00	0,00
Report à nouveau de l'exercice	0,00	0,00
Capitalisation	22 114 806,81	56 837 959,15
<b>Total</b>	<b>22 114 806,81</b>	<b>56 837 959,15</b>

	31/03/2021	31/03/2020
<b>Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA P-C</b>		
<b>Affectation</b>		
Distribution	0,00	0,00
Report à nouveau de l'exercice	0,00	0,00
Capitalisation	1 039 865,68	2 567 296,71
<b>Total</b>	<b>1 039 865,68</b>	<b>2 567 296,71</b>

**Tableau d'affectation de la quote-part des sommes distribuables afférente aux plus et moins-values nettes**

	31/03/2021	31/03/2020
<b>Sommes restant à affecter</b>		
Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées	2 777 108,62	1 136 121,11
Plus et moins-values nettes de l'exercice	-552 355 293,15	363 845 007,08
Acomptes versés sur plus et moins-values nettes de l'exercice	0,00	0,00
<b>Total</b>	<b>-549 578 184,53</b>	<b>364 981 128,19</b>

	31/03/2021	31/03/2020
<b>Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA I-C</b>		
<b>Affectation</b>		
Distribution	0,00	0,00
Plus et moins-values nettes non distribuées	0,00	0,00
Capitalisation	-222 962 495,58	130 400 888,48
<b>Total</b>	<b>-222 962 495,58</b>	<b>130 400 888,48</b>

	31/03/2021	31/03/2020
<b>Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA I-D</b>		
<b>Affectation</b>		
Distribution	0,00	0,00
Plus et moins-values nettes non distribuées	0,00	6 439 830,52
Capitalisation	-834 072,02	0,00
<b>Total</b>	<b>-834 072,02</b>	<b>6 439 830,52</b>

	31/03/2021	31/03/2020
<b>Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA O-C</b>		
<b>Affectation</b>		
Distribution	0,00	0,00
Plus et moins-values nettes non distribuées	0,00	0,00
Capitalisation	-309 018 184,92	217 855 264,62
<b>Total</b>	<b>-309 018 184,92</b>	<b>217 855 264,62</b>

	31/03/2021	31/03/2020
<b>Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA P-C</b>		
<b>Affectation</b>		
Distribution	0,00	0,00
Plus et moins-values nettes non distribuées	0,00	0,00
Capitalisation	-16 763 432,01	10 285 144,57
<b>Total</b>	<b>-16 763 432,01</b>	<b>10 285 144,57</b>

### 3.11. TABLEAU DES RÉSULTATS ET AUTRES ÉLÉMENTS CARACTÉRISTIQUES DE L'ENTITÉ AU COURS DES CINQ DERNIERS EXERCICES

	31/03/2017	29/03/2018	29/03/2019	31/03/2020	31/03/2021
<b>Actif net Global en EUR</b>	<b>2 360 877 444,96</b>	<b>2 235 546 797,93</b>	<b>1 886 902 548,51</b>	<b>1 934 557 580,58</b>	<b>1 824 797 827,87</b>
<b>Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA I-C EUR</b>					
Actif net	580 427 786,68	725 833 789,25	716 513 303,51	693 418 017,37	736 119 417,44
Nombre de titres	51 746,843	64 946,602	64 339,782	62 590,304	66 755,333
Valeur liquidative unitaire	11 216,6801	11 175,8547	11 136,3961	11 078,6810	11 027,1252
Capitalisation unitaire sur +/- valeurs nettes	-1 075,38	-476,63	433,80	2 083,40	-3 339,99
Capitalisation unitaire sur résultat	379,99	289,03	320,84	523,25	210,49
<b>Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA I-D EUR</b>					
Actif net	86 890,44	29 142 909,83	23 937 698,64	28 283 477,46	11 553 857,40
Nombre de titres	12,663	4 416,858	3 740,577	4 577,810	1 974,132
Valeur liquidative unitaire	6 861,7578	6 598,1088	6 399,4668	6 178,3860	5 852,6265
+/- valeurs nettes unitaire non distribuées en	0,00	0,00	248,18	1 406,74	0,00
Capitalisation unitaire sur +/- valeurs nettes	-314,29	-302,48	0,00	0,00	-422,50
Distribution unitaire sur résultat	239,31	175,78	188,75	298,20	113,54
Crédit d'impôt unitaire	0,00	0,00	0,00	0,001	*
<b>Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA O-C EUR</b>					
Actif net	1 631 339 546,27	1 408 915 843,12	1 084 377 558,32	1 158 161 676,48	1 021 788 515,39
Nombre de titres	16 265 352,633	14 072 365,782	10 848 594,905	11 624 896,611	10 277 403,927
Valeur liquidative unitaire	100,2953	100,1193	99,9555	99,6276	99,4208
Capitalisation unitaire sur +/- valeurs nettes	-9,60	-4,25	3,88	18,74	-30,06
Capitalisation unitaire sur résultat	3,58	2,77	3,06	4,88	2,15
<b>Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA P-C EUR</b>					
Actif net	149 023 221,57	71 654 255,73	62 073 988,04	54 694 409,27	55 336 037,64
Nombre de titres	1 493 139,530	720 778,127	626 809,580	555 336,894	564 647,814
Valeur liquidative unitaire	99,8052	99,4123	99,0316	98,4887	98,0009
Capitalisation unitaire sur +/- valeurs nettes	-9,57	-4,24	3,85	18,52	-29,68
Capitalisation unitaire sur résultat	3,35	2,54	2,82	4,62	1,84

(\*) Le crédit d'impôt unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution, conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

### 3.12. INVENTAIRE DÉTAILLÉ DES INSTRUMENTS FINANCIERS EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Actions et valeurs assimilées</b>				
<b>Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
BASF SE	EUR	322 494	22 845 474,96	1,25
BAYER	EUR	1 033 795	55 783 578,20	3,06
BMW BAYERISCHE MOTOREN WERKE	EUR	155 093	13 721 077,71	0,75
PUMA SE	EUR	16 166	1 350 507,64	0,07
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>93 700 638,51</b>	<b>5,13</b>
<b>AUTRICHE</b>				
ERSTE GROUP BANK	EUR	212 787	6 153 800,04	0,34
<b>TOTAL AUTRICHE</b>			<b>6 153 800,04</b>	<b>0,34</b>
<b>BELGIQUE</b>				
KBC GROUPE	EUR	109 089	6 763 518,00	0,37
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>6 763 518,00</b>	<b>0,37</b>
<b>ESPAGNE</b>				
BANCO DE SABADELL S.A.	EUR	9 291 719	4 237 023,86	0,24
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>4 237 023,86</b>	<b>0,24</b>
<b>FRANCE</b>				
AIRBUS SE	EUR	38 579	3 724 416,66	0,21
AIR LIQUIDE	EUR	242 000	33 710 600,00	1,85
AXA	EUR	1 607 020	36 776 652,70	2,01
BNP PARIBAS	EUR	2 310 134	119 849 751,92	6,57
BOUYGUES	EUR	1 285 013	43 934 594,47	2,40
CNP	EUR	240 000	3 890 400,00	0,21
DANONE	EUR	1 480 594	86 614 749,00	4,75
ENGIE	EUR	7 050 593	85 347 428,27	4,67
LVMH (LOUIS VUITTON - MOET HENNESSY)	EUR	158 452	90 016 581,20	4,94
MICHELIN - CATEGORIE B	EUR	293 066	37 409 874,90	2,05
NATIXIS	EUR	5 454 581	22 265 599,64	1,22
ORANGE	EUR	13 219 247	138 868 189,74	7,61
PERNOD RICARD	EUR	27 661	4 427 143,05	0,24
PUBLICIS GROUPE SA	EUR	200 988	10 459 415,52	0,58
SAINT-GOBAIN	EUR	1 733 927	87 251 206,64	4,78
SANOFI	EUR	913 131	76 931 286,75	4,21
SCOR SE	EUR	270 000	7 857 000,00	0,43
SOCIETE GENERALE SA	EUR	3 669 154	81 877 171,51	4,49
SUEZ SA	EUR	400 000	7 224 000,00	0,40
TOTAL SE	EUR	4 419 153	175 771 810,58	9,63
VALEO SA	EUR	1 032 829	29 921 056,13	1,64
VEOLIA ENVIRONNEMENT	EUR	1 202 997	26 297 514,42	1,44
VINCI (EX SGE)	EUR	885 434	77 351 514,24	4,24
VIVENDI	EUR	2 960 391	82 890 948,00	4,54
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>1 370 668 905,34</b>	<b>75,11</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
NN GROUP NV	EUR	46 283	1 929 538,27	0,10
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>1 929 538,27</b>	<b>0,10</b>
<b>TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>1 483 453 424,02</b>	<b>81,29</b>

### 3.12. INVENTAIRE DÉTAILLÉ DES INSTRUMENTS FINANCIERS EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>TOTAL Actions et valeurs assimilées</b>			<b>1 483 453 424,02</b>	<b>81,29</b>
<b>Obligations et valeurs assimilées</b>				
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
EON SE 0.375% 20-04-23 EMTN	EUR	3 300 000	3 347 640,29	0,18
HSH NORDBANK AG 0.5% 23-05-22	EUR	2 000 000	2 020 218,69	0,11
TLG IMMOBILIEN AG 0.375% 23-09-22	EUR	2 300 000	2 318 788,95	0,13
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 0.625% 01-04-22	EUR	2 000 000	2 028 746,99	0,11
VOLKSWAGEN LEASING 0.0000010% 12-07-23	EUR	3 050 000	3 052 522,53	0,16
VOLKSWAGEN LEASING 0.5% 20-06-22	EUR	1 000 000	1 011 242,26	0,06
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>13 779 159,71</b>	<b>0,75</b>
<b>AUTRICHE</b>				
OMV AG 0.0% 16-06-23 EMTN	EUR	4 050 000	4 068 215,36	0,22
RAIFFEISEN BANK INTL AG 0.25% 05-07-21	EUR	2 500 000	2 508 791,76	0,14
<b>TOTAL AUTRICHE</b>			<b>6 577 007,12</b>	<b>0,36</b>
<b>CAIMANES, ILES</b>				
HUTC WHAM FIN 1.375% 31-10-21	EUR	3 700 000	3 754 688,24	0,21
<b>TOTAL CAIMANES, ILES</b>			<b>3 754 688,24</b>	<b>0,21</b>
<b>DANEMARK</b>				
JYSKE BANK DNK 0.875% 03-12-21	EUR	2 300 000	2 325 796,86	0,12
NYKREDIT 0.25% 20-01-23 EMTN	EUR	2 300 000	2 317 182,15	0,13
SYDBANK AS 1.25% 04-02-22 EMTN	EUR	2 050 000	2 079 476,28	0,11
<b>TOTAL DANEMARK</b>			<b>6 722 455,29</b>	<b>0,36</b>
<b>ESPAGNE</b>				
CAIXABANK 1.125% 12-01-23 EMTN	EUR	4 000 000	4 091 301,36	0,22
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>4 091 301,36</b>	<b>0,22</b>
<b>ETATS-UNIS</b>				
AMERICAN HONDA FIN 1.6% 20-04-22	EUR	3 000 000	3 104 778,23	0,17
AT&T INC 2.50% 03/23	EUR	3 000 000	3 140 488,95	0,17
BMW U 1.125% 18-09-21 EMTN	EUR	1 971 000	1 997 057,00	0,11
CITIG 1.375% 27-10-21 EMTN	EUR	2 000 000	2 032 679,22	0,11
FIDELITY NATL INFORMATION 0.125% 03-12-22	EUR	2 600 000	2 614 117,01	0,15
MCKESSON 0.625% 17-08-21	EUR	2 800 000	2 819 399,53	0,16
MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.0% 15-03-23	EUR	3 500 000	3 517 493,95	0,19
METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 0.0000010% 23-09-22	EUR	2 500 000	2 511 289,55	0,14
MORGAN STANLEY CAPITAL SERVICE 1.0% 02-12-22	EUR	2 000 000	2 047 283,75	0,11
<b>TOTAL ETATS-UNIS</b>			<b>23 784 587,19</b>	<b>1,31</b>
<b>FRANCE</b>				
ALD 0.0000010% 23-02-24 EMTN	EUR	1 500 000	1 501 250,18	0,08
ALD 0.375% 19-10-23 EMTN	EUR	1 100 000	1 113 935,12	0,06
ALD E3R+0.62% 16-07-21 EMTN	EUR	1 500 000	1 501 785,69	0,08
DASSAULT SYSTEMES 0.0% 16-09-22	EUR	3 000 000	3 012 395,40	0,16
LVMH MOET HENNESSY E3R+0.2% 11-02-22	EUR	2 500 000	2 509 135,23	0,14
PSA BANQUE FRANCE 0.5% 12-04-22	EUR	3 800 000	3 844 045,14	0,21
PUBLICIS GROUPE 1.125% 16/12/21	EUR	3 700 000	3 737 078,45	0,21
RENAULT CREDIT INTL BANQUE E3R+0.65% 12-04-21	EUR	500 000	500 148,41	0,03
RENAULT CREDIT INTL BANQUE E3R+0.67% 14-03-22	EUR	1 800 000	1 805 834,93	0,10
S 0.0% 13-09-22 EMTN	EUR	1 400 000	1 406 576,93	0,08

### 3.12. INVENTAIRE DÉTAILLÉ DES INSTRUMENTS FINANCIERS EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SG 0.5% 13-01-23 EMTN	EUR	3 000 000	3 036 726,88	0,16
ST GOBAIN 3.625% 15/06/2021	EUR	3 100 000	3 213 170,85	0,18
TIGF 4.339% 07/21	EUR	2 000 000	2 086 726,40	0,11
VIVENDI 0.0% 13-06-22 EMTN	EUR	4 000 000	4 011 631,88	0,22
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>33 280 441,49</b>	<b>1,82</b>
<b>GUERNSEY</b>				
CRED SUI 1.25% 14-04-22 EMTN	EUR	2 222 000	2 277 751,89	0,13
<b>TOTAL GUERNSEY</b>			<b>2 277 751,89</b>	<b>0,13</b>
<b>IRLANDE</b>				
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 0.125% 16-11-23	EUR	2 300 000	2 308 189,33	0,13
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 0.5% 18-09-23	EUR	1 700 000	1 724 125,97	0,09
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>4 032 315,30</b>	<b>0,22</b>
<b>ITALIE</b>				
INTE 0.875% 27-06-22 EMTN	EUR	3 625 000	3 693 243,24	0,20
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>3 693 243,24</b>	<b>0,20</b>
<b>JAPON</b>				
MERCEDESBEZ FINANCE 0.0% 21-08-22	EUR	4 100 000	4 114 315,23	0,23
<b>TOTAL JAPON</b>			<b>4 114 315,23</b>	<b>0,23</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
BANK OF CHINA LUXEMBOURG 0.125% 16-01-23	EUR	3 700 000	3 703 560,97	0,21
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>3 703 560,97</b>	<b>0,21</b>
<b>NORVEGE</b>				
SANTANDER CONSUMER BANK AS 0.875% 21-01-22	EUR	1 200 000	1 214 125,72	0,07
<b>TOTAL NORVEGE</b>			<b>1 214 125,72</b>	<b>0,07</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
BMW FIN 0.125% 29-11-21 EMTN	EUR	3 000 000	3 013 173,74	0,16
DIGITAL DUTCH FINCO BV 0.125% 15-10-22	EUR	1 100 000	1 105 258,93	0,05
NATLENERLANDEN BANK NV 0.375% 31-05-23	EUR	1 500 000	1 524 010,32	0,09
SIEMENS FINANCIERINGSMAATNV 0.0% 05-09-21	EUR	1 000 000	1 001 840,72	0,05
SIEMENS FINANCIERINGSMAATNV 0.125% 05-06-22	EUR	2 600 000	2 616 801,65	0,15
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>9 261 085,36</b>	<b>0,50</b>
<b>PHILIPPINES</b>				
PHILIPPINE GOVERNMENT INTL BOND 0.0% 03-02-23	EUR	1 700 000	1 695 733,00	0,09
<b>TOTAL PHILIPPINES</b>			<b>1 695 733,00</b>	<b>0,09</b>
<b>REPUBLIQUE DE COREE</b>				
EIBKOR 0 09/21/23	EUR	1 200 000	1 207 458,00	0,07
<b>TOTAL REPUBLIQUE DE COREE</b>			<b>1 207 458,00</b>	<b>0,07</b>
<b>ROYAUME-UNI</b>				
GSK 0 09/23/21	EUR	1 800 000	1 803 381,75	0,10
HITACHI CAPITAL UK 0.125% 29-11-22	EUR	1 400 000	1 402 570,58	0,07
NATWEST MKTS E3R+0.72% 18-06-21	EUR	3 250 000	3 254 311,67	0,18
<b>TOTAL ROYAUME-UNI</b>			<b>6 460 264,00</b>	<b>0,35</b>
<b>SUEDE</b>				
SCANIA CV AB 0.0% 23-11-22	EUR	2 000 000	2 002 514,30	0,11
SCANIA CV AB 0.5% 06-10-23	EUR	1 000 000	1 015 071,72	0,06
<b>TOTAL SUEDE</b>			<b>3 017 586,02</b>	<b>0,17</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>132 667 079,13</b>	<b>7,27</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées</b>			<b>132 667 079,13</b>	<b>7,27</b>

### 3.12. INVENTAIRE DÉTAILLÉ DES INSTRUMENTS FINANCIERS EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Organismes de placement collectif</b>				
<b>OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>				
<b>FRANCE</b>				
AMUNDI CASH INSTITUTIONS SRI I	EUR	1,001	217 220,82	0,02
AMUNDI EURO LIQUIDITY-RATED SRI I	EUR	0,001	1 046,07	0,00
AMUNDI TRESO COURT TERME I C	EUR	0,302	5 593,20	0,00
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>223 860,09</b>	<b>0,02</b>
<b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>			<b>223 860,09</b>	<b>0,02</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>223 860,09</b>	<b>0,02</b>
<b>Titres reçus en garantie</b>				
<b>Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
ACCOR	EUR	245 000	7 879 200,00	0,43
AGEAS	EUR	54 000	2 784 240,00	0,15
AIRBUS SE	EUR	2 999	289 523,46	0,02
ASSICURAZIONI GENERALI	EUR	242 300	4 133 638,00	0,23
BUREAU VERITAS	EUR	413 800	10 042 926,00	0,55
CNP	EUR	31 828	515 931,88	0,03
DEUTSCHE WOHNEN SE	EUR	80 000	3 182 400,00	0,18
EDENRED	EUR	64 373	2 867 173,42	0,16
EVONIK INDUSTRIES AG	EUR	125 000	3 770 000,00	0,20
GETLINK SE	EUR	1 099 683	14 383 853,64	0,79
IPSEN	EUR	280 000	20 482 000,00	1,12
KION GROUP AG	EUR	8 900	749 380,00	0,05
PORSCHE A HOLDING	EUR	50 643	4 579 140,06	0,25
ROYAL MAIL PLC-W/I	GBP	116 087	687 650,41	0,03
RWE AG	EUR	90 000	3 007 800,00	0,16
SAINT-GOBAIN	EUR	25 000	1 258 000,00	0,07
SEB	EUR	6 900	1 037 760,00	0,06
SODEXO / EX SODEXHO ALLIANCE	EUR	45 000	3 680 100,00	0,20
TAG TEGERNSEE IMMOBILIEN	EUR	48 800	1 187 792,00	0,06
VEOLIA ENVIRONNEMENT	EUR	31 218	682 425,48	0,04
VONOVIA SE	EUR	50 000	2 785 000,00	0,15
<b>TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>89 985 934,35</b>	<b>4,93</b>
<b>OPC européens coordonnés et assimilables</b>				
AMUNDI ETF PEA MSCI EUROPE UCITS ETF - EUR	EUR	39 530	897 923,95	0,05
<b>TOTAL OPC européens coordonnés et assimilables</b>			<b>897 923,95</b>	<b>0,05</b>
<b>TOTAL Titres reçus en garantie</b>			<b>90 883 858,30</b>	<b>4,98</b>
<b>Dettes représentatives des titres reçus en garantie</b>			-90 883 858,30	-4,98
<b>Créance représentative de titres prêtés</b>				
<b>ESPAGNE</b>				
BANCO DE SABADELL S.A.	EUR	1 050 344	478 956,86	0,03
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>478 956,86</b>	<b>0,03</b>
<b>FRANCE</b>				
AXA	EUR	6 003 620	137 392 843,71	7,53
BNP PARIBAS	EUR	1 066 600	55 335 208,00	3,03
BOUYGUES	EUR	265 600	9 080 864,00	0,49
ENGIE	EUR	71 000	859 455,00	0,05

### 3.12. INVENTAIRE DÉTAILLÉ DES INSTRUMENTS FINANCIERS EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
NATIXIS	EUR	79 329	323 820,98	0,01
ORANGE	EUR	968 067	10 169 543,84	0,56
SANOFI	EUR	127 000	10 699 750,00	0,58
SOCIETE GENERALE SA	EUR	29 000	647 135,00	0,04
VALEO SA	EUR	16 000	463 520,00	0,03
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>224 972 140,53</b>	<b>12,32</b>
<b>TOTAL Créance représentative de titres prêtés</b>			<b>225 451 097,39</b>	<b>12,35</b>
<b>Indemnités sur titres prêtés</b>			70 730,93	0,01
<b>Indemnités sur titres empruntés</b>			204,47	0,00
<b>Instruments financier à terme</b>				
<b>Engagements à terme fermes</b>				
<b>Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé</b>				
XEUR FGBS SCH 0621	EUR	-432	2 160,00	0,00
<b>TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé</b>			<b>2 160,00</b>	<b>0,00</b>
<b>TOTAL Engagements à terme fermes</b>			<b>2 160,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Autres instruments financiers à terme</b>				
<b>Autres swaps</b>				
BANK OF AMERICA SECU	EUR	170 000 025	-2 535 533,37	-0,14
BNP PARIBAS	EUR	155 000 025,93	615 019,95	0,04
GOLDMAN SACHS	EUR	250 000 000	-5 152 632,50	-0,28
GOLDMAN SACHS	EUR	100 000 000	-11 359 500,00	-0,63
GOLDMAN SACHS	EUR	110 000 000	-2 817 333,20	-0,15
GOLDMAN SACHS	EUR	100 000 000	-693 600,00	-0,04
JP MORGAN	EUR	400 000 002,75	-8 497 600,06	-0,46
JP MORGAN	EUR	249 999 999,33	-21 264 499,94	-1,17
SOCIETE GENERALE	EUR	125 000 047,33	-463 625,18	-0,03
<b>TOTAL Autres swaps</b>			<b>-52 169 304,30</b>	<b>-2,86</b>
<b>TOTAL Autres instruments financiers à terme</b>			<b>-52 169 304,30</b>	<b>-2,86</b>
<b>TOTAL Instruments financier à terme</b>			<b>-52 167 144,30</b>	<b>-2,86</b>
<b>Appel de marge</b>				
APPEL MARGE CACEIS	EUR	-2 160	-2 160,00	0,00
<b>TOTAL Appel de marge</b>			<b>-2 160,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Créances</b>			<b>45 784 644,08</b>	<b>2,51</b>
<b>Dettes</b>			<b>-167 633 299,62</b>	<b>-9,19</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>156 949 391,68</b>	<b>8,60</b>
<b>Actif net</b>			<b>1 824 797 827,87</b>	<b>100,00</b>

Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA I-D	EUR	1 974,132	5 852,6265
Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA I-C	EUR	66 755,333	11 027,1252
Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA P-C	EUR	564 647,814	98,0009
Parts AMUNDI SERENITE PEA PEA O-C	EUR	10 277 403,927	99,4208

## Complément d'information relatif au régime fiscal du coupon

Décomposition du coupon : Part AMUNDI SERENITE PEA PEA I-D

	NET GLOBAL	DEVISE	NET UNITAIRE	DEVISE
Revenus soumis à un prélèvement à la source obligatoire non libératoire	0,00		0,00	
Actions ouvrant droit à abattement et soumis à un prélèvement à la source obligatoire non libératoire	224 142,95	EUR	113,54	EUR
Autres revenus n'ouvrant pas droit à abattement et soumis à un prélèvement à la source obligatoire non libératoire	0,00		0,00	
Revenus non déclarables et non imposables	0,00		0,00	
Montant des sommes distribuées sur les plus et moins-values	0,00		0,00	
TOTAL	224 142,95	EUR	113,54	EUR