

RAPPORT
ANNUEL

Septembre

2022

Amundi Index Solutions

SICAV à compartiments multiples de droit luxembourgeois

Management Company
Amundi Luxembourg S.A.

Agent Administrative
CACEIS Bank, Luxembourg Branch

Depositaire
CACEIS Bank, Luxembourg Branch



AMUNDI INDEX SOLUTIONS

Rapport annuel et états financiers vérifiés

R.C.S. Luxembourg B 206.810

Au 30/09/22

Aucune souscription ne peut être acceptée sur base des rapports financiers. Les souscriptions ne sont valables que si elles ont été effectuées sur base du prospectus qui sera accompagné du dernier rapport annuel et du dernier rapport semestriel si celui-ci est plus récent que le rapport annuel.



	Page
Organisation	4
Rapport de gestion	7
Portefeuille - Titres au 30/09/22	
AMUNDI CAC 40 ESG	10
AMUNDI EURO STOXX 50	11
AMUNDI JAPAN TOPIX	12
AMUNDI JPX-NIKKEI 400	15
AMUNDI MSCI BRAZIL	17
AMUNDI MSCI CHINA	18
AMUNDI MSCI EASTERN EUROPE EX RUSSIA	19
AMUNDI MSCI EM ASIA	20
AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA	23
AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS	25
AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND	28
AMUNDI MSCI INDIA	29
AMUNDI MSCI NORDIC	30
AMUNDI MSCI SWITZERLAND	31
AMUNDI MSCI USA	33
AMUNDI MSCI WORLD	35
AMUNDI MSCI WORLD ENERGY	38
AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE	39
AMUNDI MSCI WORLD FINANCIALS	41
AMUNDI RUSSELL 2000	42
AMUNDI S&P 500	44
AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY	49
AMUNDI SMART CITY	51
AMUNDI SMART FACTORY	52
AMUNDI STOXX GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE	53
AMUNDI DAX 50 ESG	55
AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG	56
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB	61
AMUNDI BBB EURO CORPORATE INVESTMENT GRADE	65
AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE ESG	71
AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKET IBOXX	75
AMUNDI GOVT BOND EUROMTS BROAD INVESTMENT GRADE	76
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EUROMTS INVESTMENT GRADE	80
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EUROMTS INVESTMENT GRADE 1-3	82
AMUNDI US TREASURY 1-3	83
AMUNDI US TREASURY 3-7	84
AMUNDI US TREASURY 7-10	85
Etat du Patrimoine au 30/09/22	86
Indications Financières	93
Etat des Opérations et des Variations des Actifs Nets	100
Notes aux états financiers au 30/09/22	107
Rapport d'audit	118
Information Générale (non audité)	123
SECURITIES FINANCING TRANSACTIONS AND OF REUSE REGULATION ("SFTR")	
1. OPÉRATIONS DE PRÊT DE TITRES	123
2. EQUITIES SWAP	127

POLITIQUE ET PRATIQUES DE RÉMUNÉRATION	132
MÉTHODE DE CALCUL DE L'EXPOSITION GLOBALE	133
Informations à l'Attention des investisseurs en Suisse	134
RÈGLEMENT SUR LA PUBLICATION D'INFORMATIONS EN MATIÈRE DE DURABILITÉ DANS LE SECTEUR DES SERVICES FINANCIERS ("SFDR")	141

DÉNOMINATION ET SIÈGE SOCIAL**AMUNDI INDEX SOLUTIONS**

5, allée Scheffer
L-2520 Luxembourg

CONSEIL D'ADMINISTRATION DE LA SICAV**Président****Fannie Wurtz**

Head of ETF, Indexing & Smart Beta Business Line
Amundi Asset Management
91-93, boulevard Pasteur
F-75730 Paris Cedex 15, France

Directeurs**Jeanne Duvoux**

Managing Director
Amundi Luxembourg
5, allée Scheffer
L-2520 Luxembourg

Christophe Lemarié

Head of Cross Border Platform and Deputy Head of Retail Marketing
Amundi Ireland Ltd
1, George's Quay Plaza
George's Quay
Dublin 2, Ireland

Nicolas Vauléon

Managing Director
Amundi Global Services
5, allée Scheffer
L-2520 Luxembourg

Société de gestion**Amundi Luxembourg S.A.**

5, allée Scheffer
L-2520 Luxembourg

CONSEIL D'ADMINISTRATION DE LA SOCIÉTÉ DE GESTION au 30 Septembre 2022**David Joseph Harte**

Deputy Head of Operations, Services & Technology Division
Amundi Ireland Ltd
1, George's Quay Plaza
George's Quay
Dublin 2, Ireland

Jeanne Duvoux

Managing Director
Amundi Luxembourg
5, allée Scheffer
L-2520 Luxembourg

Enrico Turchi

Managing Director
Amundi Luxembourg
5, allée Scheffer
L-2520 Luxembourg

Christian Pellis (jusqu'au 8 Octobre 2021)

Global Head of Distribution
Amundi Asset Management
91-93, boulevard Pasteur
F-75730 Paris Cedex 15, France

Claude Kremer

Partner of Arendt & Medernach
41A, avenue J.F. Kennedy
L-2082, Luxembourg

Pascal Biville

Independent Director

François Marion

Independent Director

PERSONNEL DE LA SOCIETE DE GESTION

Mrs. Jeanne Duvoux, Managing Director / Chief Executive Officer
Mr. Enrico Turchi, Managing Director / Deputy Chief Executive Officer
Mr. Charles Giraldez, Deputy Chief Executive Officer
Mr. Pierre Bosio, Chief Operating Officer
Mr. Benjamin Launay, Real Estate Portfolio Manager
Mr. Hervé Leclercq, Head of Real and Private Assets (jusqu'au 28 février 2022)

GESTIONNAIRES EN INVESTISSEMENTS

Amundi Asset Management
90, boulevard Pasteur
F-75015 Paris, France

Amundi Japan Ltd
Hibiya Dai Building, 1-2-2
Uchisawai-cho,
Chiyoda-ku
Tokyo # 100-0011, Japon

**BANQUE DÉPOSITAIRE, AGENT ADMINISTRATIF,
AGENT DE REGISTRE ET AGENT PAYEUR**

CACEIS Bank, Luxembourg branch
5, allée Scheffer,
L-2520 Luxembourg

AUDITEUR

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
2, rue Gerhard Mercator
L-2182 Luxembourg

CONSEILLER JURIDIQUE

Arendt & Medernach S.A.
41A, avenue J.F. Kennedy
L-2082 Luxembourg

Gouvernance d'entreprise et Code de bonne conduite de l'ALFI

Le Conseil d'administration a la responsabilité de veiller au respect d'un degré élevé de gouvernance d'entreprise et estime, à ce titre, que le Fonds s'est conformé aux meilleures pratiques en vigueur dans l'industrie des fonds luxembourgeois. Le Conseil d'administration a suivi plus particulièrement les principes du Code de bonne conduite de l'ALFI (le « Code »), lequel énonce des principes de bonne gouvernance applicables aux fonds luxembourgeois. Le Conseil d'administration considère que le Fonds a bien observé les principes de ce Code, à tous les égards importants, au cours de cet exercice financier.

Commentaire annuel sur les marchés financiers

États-Unis

Le troisième trimestre 2021 a été marqué par le ralentissement de la reprise économique américaine, la hausse des taux d'intérêt et la chute du revenu réel des ménages sur fond d'inflation élevée. Les principaux indicateurs économiques (ISM) ont dénoté une croissance continue de l'activité, mais à un rythme nettement moins soutenu, tandis que les indicateurs de confiance des ménages sont restés très médiocres. Les chiffres pour le secteur immobilier, notamment sensible aux taux d'intérêt, étaient particulièrement décourageants. D'un autre côté, la création d'emploi est restée robuste, le taux de chômage faible, et le marché du travail a vu le retour de nombreux travailleurs qui avaient renoncé à chercher un emploi pendant la pandémie. L'inflation a augmenté légèrement en juillet et en août par rapport au mois de juin, mais elle est restée accrochée à un niveau très élevé (l'inflation de base est repartie à la hausse en août). La banque centrale américaine (Fed) a poursuivi son resserrement monétaire (deux relèvements de 0,75 % des taux des Fed Funds en juillet et septembre) et a clairement fait part de son intention de prioriser les mesures de lutte contre l'inflation, dût-il y avoir des conséquences négatives sur le marché du travail.

Au quatrième trimestre, l'activité économique américaine a connu un nouveau coup d'accélérateur, après le coup de mou de la fin du troisième trimestre. Les chiffres et les enquêtes économiques mensuels ont confirmé la dynamique positive dans le secteur privé, les sociétés industrielles et des services annonçant une nette embellie du climat économique. Ceci étant, les volumes de production ont continué de pâtir d'importantes difficultés dans les chaînes d'approvisionnement et de la pénurie de produits semi-finis, en dépit de certains signes d'amélioration au quatrième trimestre. Les ventes de détail ont enflé de 0,3 % en novembre, après une augmentation de 1,7 % en octobre, tandis que la production industrielle s'est arrogé 0,5 %. Le taux de chômage s'est établi à 4,2 % en novembre, en baisse par rapport aux 4,6 % du mois d'octobre, le marché du travail poursuivant sur la voie de l'amélioration. L'inflation s'est accélérée en novembre, pour s'établir à 6,8 % en glissement annuel, portée par des effets de base et par des facteurs temporaires, mais aussi par des causes plus structurelles. Jerome Powell a été reconduit pour un second mandat à la tête de la Fed. En décembre, la Federal Reserve a annoncé qu'elle allait doubler le rythme de réduction de ses achats d'actifs en janvier, pour le ramener à 30 milliards USD par mois, les achats nets devant se terminer en mars.

Au début du premier trimestre 2022, les chiffres économiques dénotaient un ralentissement de l'activité et de la mobilité en janvier, en raison de la propagation du variant Omicron. Mais la situation s'est améliorée à partir de février. Les indicateurs de confiance des entreprises ont suivi la même tendance, malgré des indicateurs dans l'industrie pointant vers un ralentissement, tandis que le marché du travail américain a continué de se renforcer. En dépit d'un début de résolution des goulets d'étranglement au niveau du commerce mondial, la pression haussière sur les prix est demeurée forte en raison d'importants déséquilibres entre l'offre et la demande. Les enquêtes sur la confiance des consommateurs (comme celle du Conférence Board) ont mis en lumière certains problèmes à propos de la situation économique future, en raison sans doute de l'envolée des prix de l'énergie et de la guerre en Ukraine. L'augmentation notable des attentes des ménages en termes d'inflation s'est reflétée dans l'accélération de l'indice des prix à la consommation, qui était très proche des 8 % en glissement annuel en février.

Au deuxième trimestre 2022, l'économie américaine a ralenti, en témoignaient alors la détérioration de la confiance des consommateurs et l'inflation persistante (affectant le revenu disponible), tirée par les coûts élevés de l'énergie et des services. L'inflation des prix à la consommation la plus récente pour le mois de mai a atteint son plus haut niveau depuis quarante ans, maintenant la pression sur la Fed pour qu'elle offre une réponse à un problème devenu politique dans le pays, les élections de mi-mandat attendant le président Joe Biden cette année. La Fed a relevé ses taux directeurs de 75 points de base en juin et allait sans doute rester sur la trajectoire du resserrement à court terme. Les pressions ont néanmoins continué de s'accumuler sur la croissance économique américaine, tandis que le PMI manufacturier de juin était en berne. Résultat : la tâche de la Fed s'annonçait difficile à la lumière de sa double mission de trouver un équilibre entre stabilité des prix et croissance économique. Ceci dit, la robustesse des marchés du travail et la faiblesse des taux de chômage signifient que la consommation globale était vigoureuse.

Zone euro

Dans la zone euro, l'environnement économique s'est détérioré notablement au troisième trimestre 2021. L'économie de la zone euro, déjà en proie à une inflation record, à un resserrement monétaire et aux retombées du ralentissement en Chine, a en plus dû faire face à une envolée des prix du gaz naturel consécutive à la réduction drastique des approvisionnements russes. Les craintes d'une récession dans la zone euro sont apparues à la fin du trimestre, sur fond de crise énergétique. Les indicateurs de confiance des entreprises ont fait une légère incursion en territoire négatif, tandis que les indicateurs de confiance des ménages, qui étaient déjà à des niveaux planchers, ont continué de baisser. De l'autre côté, le marché du travail est resté actif, le taux de chômage étant à son niveau le plus bas depuis la création de la zone euro. La hausse de l'inflation a atteint les 10 % en septembre 2021. Après avoir relevé ses taux directeurs de 0,50 % en juillet (la première augmentation depuis 2011), la Banque centrale européenne (BCE) les a de nouveau relevés en septembre, de 0,75 %. La BCE a fait part de son intention de poursuivre ce cycle haussier pour combattre l'inflation, malgré la dégradation des prévisions de croissance.

L'activité économique a décéléré dans la zone euro à la fin du quatrième trimestre, comme l'ont confirmé les chiffres et les enquêtes économiques mensuels, en raison de l'explosion des cas de COVID-19. Les problèmes de la chaîne d'approvisionnement ont continué de peser lourdement sur la production industrielle, qui pâtit des pénuries de produits semi-finis et d'une forte pression à la hausse sur les prix. Toutefois, des signes d'un possible soulagement sont apparus au cours du quatrième trimestre dans la zone euro. Les ventes de détail étaient en hausse de 0,2 % en octobre (+1,4 % en glissement annuel), tandis que la production industrielle a enflé de 1,1 % (+3,3 % en glissement annuel). Le marché du travail a poursuivi sa progression au quatrième trimestre, avec un recul du taux de chômage à 7,3 % en octobre, en baisse par rapport aux 7,4 % du mois de septembre. L'inflation s'est accélérée pour atteindre 4,9 % en novembre en raison d'effets de base, de graves problèmes au niveau du commerce international, d'un rebond de la demande et d'une forte contribution à la hausse des prix de l'énergie. La BCE a annoncé une réduction majeure de ses achats : elle va poursuivre son programme d'achats d'urgence face à la pandémie au premier trimestre de 2022 « à un rythme moins soutenu qu'au trimestre précédent », pour le terminer en mars 2022, tout en réduisant alors graduellement aussi son programme d'achat d'actifs.

Les chiffres du PIB de la zone euro publiés fin janvier ont montré un net ralentissement de la croissance économique dans la zone euro au quatrième trimestre 2021 : le PIB allemand s'est contracté, tandis que le PIB en France, en Espagne et en Italie a augmenté nettement moins qu'au troisième trimestre. Les chiffres pour le premier trimestre 2022 dénotaient une poursuite du ralentissement de l'activité au tout début de l'année, en raison de la propagation du variant Omicron. Ceci dit, à partir de la mi-janvier, les enquêtes relatives à l'économie et à la consommation, et les données de mobilité ont fait montre d'une nette amélioration. Les indices PMI montraient que les Services, en particulier, avaient souffert en janvier, avant de rebondir en février, tandis que le secteur industriel était plus robuste. Mais le mois de mars a été le théâtre d'une nouvelle dégradation en raison de la guerre en Ukraine : le PMI manufacturier a chuté à un niveau bas inédit en quatorze mois, s'affichant à 56,5. Le marché du travail a continué de s'améliorer mais le problème de l'inflation devenait de plus en plus pesant pour les ménages, l'indice des prix à la consommation atteignant de nouveaux sommets sur fond de hausse continue des prix de l'énergie. La flambée des prix des matières premières et les sanctions infligées en raison de la guerre en Ukraine ont renforcé considérablement le risque de stagflation dans la zone euro, où la récession et une inflation prolongée au-dessus des 5 % faisaient partie des scénarios possibles.

Au deuxième trimestre 2022, les craintes de stagflation se sont renforcées dans la zone euro, après l'augmentation des prix et la pression apparue sur les prévisions de croissance, qu'ont aggravé les tensions géopolitiques et la décision de la Russie de couper le robinet du gaz. Tandis que les leaders mondiaux discutaient et cherchaient à savoir comment se détourner du gaz russe à long terme et renforcer leurs lignes de défense en Europe orientale, les ramifications à court terme sont devenues apparentes. Alors que le dernier indice composite PMI de la zone euro s'est affiché à son plus bas en plus d'un an, les prix à la consommation ont augmenté de 8,6 % (en glissement annuel) en juin. Les effets de cette diminution du pouvoir d'achat se sont également ressentis dans la politique française. Le président Macron a perdu sa majorité après le second tour des élections. D'un autre côté, la tâche de la BCE commençait à se compliquer dans la mesure où elle tentait de trouver un équilibre entre la maîtrise de l'inflation (partiellement causée par les problèmes du côté de l'approvisionnement) et l'évitement d'une fragmentation au sein de l'UE. Pour terminer, la BCE a décidé de mettre un terme à ses achats nets d'actifs liés à son programme d'achats d'actifs et de créer un nouvel outil anti-fragmentation.

Marchés émergents

En Chine, alors que la croissance économique était atone au deuxième trimestre 2021 en raison des restrictions liées à la COVID, elle a commencé à se reprendre durant l'été 2021, grâce au relâchement des mesures visant à contenir la pandémie, et à l'assouplissement de la politique monétaire et fiscale. Ceci étant, les autorités chinoises ont annoncé de nouvelles restrictions de déplacement devant le Congrès du Parti à la mi-octobre. Dans l'ensemble, pour le reste des marchés émergents, ce troisième trimestre 2021 a été marqué par des révisions à la baisse des prévisions de croissance. Cela s'est joué sur fond des éléments suivants : i) inflation élevée et resserrement des conditions monétaires mondiales et locales, qui affectent de plus en plus la demande nationale, ii) un ralentissement du commerce mondial, ainsi que iii) des prévisions de récession dans la zone euro et une croissance plus faible que prévu aux États-Unis. En raison de la crise énergétique européenne et de l'augmentation des prix, le ralentissement économique semblait plus prononcé en Europe centrale et orientale qu'en Amérique latine. La situation économique en Asie est restée stable. D'un autre côté, les chiffres de l'inflation étaient très élevés et augmentaient partout, malgré un certain niveau de stabilisation ou de diminution dans certains pays, comme le Brésil. Sans surprise, les banques centrales des pays émergents ont continué à augmenter les taux d'intérêt (excepté pour la Russie et la Turquie), tandis que les retardataires ont finalement rejoint la tendance (Thaïlande, Indonésie, etc.). Tandis que les perspectives d'augmentation des taux d'intérêt grandissaient en Asie, le cycle était peut être atteint dans d'autres pays émergents (Brésil, Hongrie, République tchèque, etc.). Ceci étant, l'inflation était toujours accrochée à des niveaux à deux chiffres en République tchèque et en Hongrie.

Les prévisions pour les économies émergentes ont continué à se détériorer au quatrième trimestre 2021 et au premier trimestre 2022, même si le fossé avec les économies avancées est resté favorable aux premières. L'économie chinoise, pénalisée par les contraintes politiques imposées au début du quatrième trimestre, s'est redressée légèrement. Les décideurs politiques chinois ont créé la surprise à la fin de l'année en restaurant une politique monétaire largement accommodante (par le biais d'une diminution des ratios de réserves obligatoires de 50 points de base). Ils ont également indiqué que la stabilité de la croissance par la baisse de la demande nationale serait la priorité de leur politique en 2022. En ce qui concerne l'inflation, à l'exception de l'Asie où les pressions inflationnistes ont été contenues, les chiffres de l'inflation surfaient toujours sur des niveaux élevés, bien au-dessus des objectifs de la banque centrale dans certains pays, contraignant les banques centrales à poursuivre ou à amplifier leur politique monétaire stricte. La flambée des prix de l'énergie, du pétrole et des produits alimentaires, et les problèmes de la chaîne d'approvisionnement, sont restés la principale cause de ces niveaux élevés de l'inflation. Des facteurs nationaux ont également alimenté ces pressions inflationnistes : l'augmentation des prix de l'immobilier et des salaires, la dépréciation de la monnaie, etc. Le climat est devenu plus incertain à la fin de la période en raison de la propagation rapide du variant Omicron. Certains pays ont de nouveau introduit des mesures sanitaires réduisant la mobilité des personnes.

Au deuxième trimestre 2022, les marchés émergents ont affiché un environnement économique divergent, marqué avant toutes choses par l'inflation et les politiques de la banque centrale. En Chine, la politique de tolérance zéro COVID du gouvernement a affecté l'activité économique de manière négative. Résultat : la banque centrale chinoise a abaissé son taux directeur en mai afin de soutenir la croissance. Tandis que le PMI manufacturier était vigoureux en juin, les prévisions de croissance en Chine étaient toujours freinées par les politiques anti-Covid. D'un autre côté, la Banque de réserve de l'Inde a relevé son taux directeur de 50 points de base en juin afin de contrôler l'inflation. Ailleurs, les exportateurs latino-américains ont profité de la hausse des prix des matières premières mais ont continué de faire face à une inflation persistante. Au Brésil, en plus du resserrement monétaire, les autorités ont mis en place un soutien fiscal pour compenser l'impact des prix élevés. La situation géopolitique et l'invasion de l'Ukraine par la Russie ont continué d'affecter le coût des produits alimentaires et des matières premières dans les pays d'Europe orientale. Dans le même temps, la banque centrale russe a réduit ses taux à de nombreuses reprises pour sauver l'économie russe, ébranlée par les sanctions occidentales. En Turquie, par contre, les dirigeants politiques ont juré qu'ils poursuivraient leurs politiques peu orthodoxes afin de maîtriser les prix.

Compartiment - principale catégorie d'actions (en devise de base)	Performance de la catégorie d'actions - 1 an	Indice de référence	Performance de l'indice de référence - 1 an	Écart de performance	Tracking Error réalisée	Tracking Error anticipée
AMUNDI CAC 40 ESG UCITS ETF DR - EUR	-10.60%	100% CAC 40 ESG NR Close	-11.03%	0.43%	0.28%	1%
AMUNDI EURO STOXX 50 UCITS ETF DR - EUR	-15.53%	100% EURO STOXX 50 NR Close	-15.91%	0.37%	0.16%	1%
AMUNDI JAPAN TOPIX UCITS ETF - DAILY HEDGED EUR	-9.00%	100% TOPIX TOKYO SE HEDGED NR Close	-8.13%	-0.87%	0.01%	1%
AMUNDI JPX-NIKKEI 400 UCITS ETF - EUR	-16.16%	100% NIKKEI 400 (JPN 400) NR Close	-15.98%	-0.18%	0.00%	1%
AMUNDI MSCI BRAZIL - UCITS ETF	3.68%	100.0% MSCI BRAZIL NR Close	4.32%	-0.63%	0.02%	1%
AMUNDI MSCI CHINA UCITS ETF - EUR	-6.62%	100% MSCI CHINA H NR Close	-5.93%	-0.69%	0.01%	1%
AMUNDI MSCI EASTERN EUROPE EX RUSSIA UCITS ETF - EUR	-38.64%	100% MSCI EM EASTERN EUROPE EX RUSSIA NR Close	-38.55%	-0.09%	0.01%	1%
AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF - EUR	-16.76%	100% MSCI EM ASIA NR Close	-16.61%	-0.15%	0.02%	1%
AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF - EUR	18.32%	100% MSCI EM LATIN AMERICA NR Close	18.59%	-0.27%	0.04%	1%
AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF - EUR	-15.05%	100% MSCI EM (EMERGING MARKETS) NR Close	-14.96%	-0.09%	0.02%	1%
AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND UCITS ETF - EUR	-12.64%	100% MSCI EUROPE EX SWITZERLAND (EUR) NR CLOSE	-12.78%	0.14%	0.07%	1%
AMUNDI MSCI INDIA UCITS ETF - EUR	5.06%	100% MSCI INDIA NR Close	6.55%	-1.49%	0.08%	1%
AMUNDI MSCI NORDIC UCITS ETF - EUR	-16.15%	100% MSCI NORDIC COUNTRIES NR Close	-16.31%	0.16%	0.00%	1%
AMUNDI MSCI SWITZERLAND UCITS ETF - EUR	-1.42%	100% MSCI SWITZERLAND NR Close	-1.25%	-0.17%	0.00%	1%
AMUNDI MSCI USA UCITS ETF - EUR	-2.44%	100% MSCI USA NR Close	-2.52%	0.08%	0.01%	1%
AMUNDI MSCI WORLD UCITS ETF - EUR	-5.01%	100% MSCI WORLD NR Close	-4.92%	-0.09%	0.01%	1%

Compartiment - principale catégorie d'actions (en devise de base)	Performance de la catégorie d'actions - 1 an	Indice de référence	Performance de l'indice de référence - 1 an	Écart de performance	Tracking Error réalisée	Tracking Error anticipée
AMUNDI MSCI WORLD ENERGY UCITS ETF - EUR	50.43%	100% MSCI WORLD ENERGY (GICS INDUSTRY GROUP 1010) NR Close	51.00%	-0.57%	0.02%	1%
AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE UCITS ETF - EUR	-3.75%	100% MSCI WORLD EX EUROPE NR Close	-3.55%	-0.20%	0.00%	1%
AMUNDI MSCI WORLD FINANCIALS UCITS ETF - EUR	-5.02%	100% MSCI WORLD FINANCIALS (GICS SECTOR 40) NR Close	-4.84%	-0.18%	0.02%	1%
AMUNDI RUSSELL 2000 UCITS ETF - EUR	-9.89%	100% RUSSELL 2000 (FRC) NR Close	-9.83%	-0.06%	0.04%	1%
AMUNDI S&P 500 UCITS ETF - EUR	-0.15%	100% S&P 500 COMPOSITE NR Close	-0.46%	0.31%	0.03%	1%
AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY UCITS ETF - EUR	-10.79%	100% S&P GLOBAL LUXURY NR Close	-10.18%	-0.61%	0.00%	1%
AMUNDI SMART CITY UCITS ETF	-18.15%	100% SOLACTIVE SMART CITY INDEX NR Close	-17.52%	-0.62%	0.00%	1%
AMUNDI SMART FACTORY UCITS ETF - EUR	-24.89%	100% SOLACTIVE SMART FACTORY INDEX NR Close	-24.33%	-0.56%	0.01%	1%
AMUNDI STOXX GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE - UCITS ETF	-15.39%	100% STOXX AI GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE ADTV5 INDEX VALUE NR Close	-14.80%	-0.59%	0.00%	1%
AMUNDI DAX 50 ESG UCITS ETF DR - EUR	-22.73%	100% DAX 50 ESG NR Close	-22.89%	0.16%	0.18%	1%
AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG UCITS ETF DR - EUR	-12.67%	100% STOXX EUROPE 600 ESG BROAD MARKET INDEX NR Close	-12.67%	0.00%	0.12%	1%
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB - UCITS ETF DR - EUR	-12.71%	100% MSCI EUROPE ESG BROAD SELECT CTB NR Close	-12.88%	0.17%	0.13%	1%
AMUNDI BBB EURO CORPORATE INVESTMENT GRADE ESG - UCITS ETF DR - EUR	-16.34%	100% IBOXX MSCI ESG EUR CORPORATES BBB TCA INDEX NR Close	-16.01%	-0.33%	0.23%	1%
AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE ESG - UCITS ETF DR - USD	-0.17%	100% IBOXX MSCI ESG USD FRN INVESTMENT GRADE CORPORATES TCA INDEX NR Close	0.08%	-0.25%	0.07%	1%
AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX UCITS ETF DR - USD	-21.13%	100% MARKIT IBOXX USD LIQUID EMERGING MARKETS SOVEREIGNS MID PRICE TCA NR Close	-21.28%	0.15%	0.43%	1%
AMUNDI GOVT BOND EURO BROAD INVESTMENT GRADE UCITS ETF DR - EUR	-17.45%	100% FTSE EUROZONE GOVERNMENT BROAD IG (17H15) RI Open	-17.33%	-0.12%	0.05%	1%
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE UCITS ETF DR - EUR	-17.84%	100% FTSE EUROZONE LOWEST-RATED GOVERNMENT BOND IG (17H15) RI Open	-17.72%	-0.12%	0.02%	1%
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE 1-3 UCITS ETF DR - EUR	-4.72%	100% FTSE EUROZONE LOWEST-RATED GOVERNMENT BOND IG 1-3Y (17H15) TR Open	-4.64%	-0.09%	0.04%	1%
AMUNDI US TREASURY 1-3 UCITS ETF DR - USD	-4.93%	100% IBOXX USD TREASURIES 1-3Y TR Close	-4.82%	-0.11%	0.02%	1%
AMUNDI US TREASURY 3-7 - UCITS ETF DR - USD	-11.17%	100% IBOXX USD TREASURIES 3-7Y TR Close	-11.09%	-0.08%	0.05%	1%
AMUNDI US TREASURY 7-10 UCITS ETF DR - USD	-15.35%	100% IBOXX USD TREASURIES 7-10Y TR Close	-15.22%	-0.13%	0.07%	1%

* Les chiffres du TE brut sont calculés avant le Swing Pricing et avant les frais.

Luxembourg, 17 Novembre 2022

Note : Les informations contenues dans le présent rapport sont historiques et ne préjugent pas nécessairement des performances futures.

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	787,819,869.37	100.02
Actions	787,819,869.37	100.02
Belgique	4,112,928.16	0.52
51,644.00 SOLVAY	4,112,928.16	0.52
France	728,853,681.62	92.54
138,152.00 ACCOR SA	2,985,464.72	0.38
383,090.00 AIR LIQUIDE NOM. PRIME FIDELITE	45,036,060.40	5.72
9,615.00 AIR LIQUIDE SA	1,130,339.40	0.14
238,424.00 ALSTOM SA	3,992,409.88	0.51
41,810.00 ARKEMA SA	3,139,094.80	0.40
1,402,588.00 AXA SA	31,523,165.31	4.00
833,651.00 BNP PARIBAS SA	36,351,351.86	4.61
220,654.00 BUREAU VERITAS SA	5,070,628.92	0.64
116,431.00 CAPGEMINI SE	19,269,330.50	2.45
445,549.00 CARREFOUR SA	6,333,479.04	0.80
351,243.00 CIE DE SAINT-GOBAIN	13,013,553.15	1.65
535,898.00 CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	12,408,718.20	1.58
1,021,827.00 CREDIT AGRICOLE SA	8,546,561.03	1.09
481,774.00 DANONE SA	23,399,763.18	2.97
187,298.00 EDENRED SA	8,870,433.28	1.13
437,491.00 EDF SA	5,201,767.99	0.66
1,342,676.00 ENGIE --- REGISTERED LOYALTY BONUS	15,899,969.19	2.02
27,956.00 ENGIE SA	331,054.95	0.04
133,111.00 FAURECIA	1,494,836.53	0.19
23,767.00 HERMES INTERNATIONAL SA	28,924,439.00	3.67
56,190.00 KERING	25,765,924.50	3.27
200,228.00 LEGRAND SA	13,347,198.48	1.69
181,250.00 L'OREAL SA	59,857,812.50	7.60
130,294.00 LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	79,531,457.60	10.11
1,397,329.00 ORANGE	12,922,498.59	1.64
154,857.00 PERNOD RICARD SA	29,244,744.45	3.71
171,448.00 PUBLICIS GROUPE	8,383,807.20	1.06
184,241.00 REXEL SA	2,852,050.68	0.36
256,492.00 SAFRAN SA	24,112,812.92	3.06
856,038.00 SANOFI	67,113,379.20	8.53
428,565.00 SCHNEIDER ELECTRIC SE	50,116,391.10	6.36
605,889.00 SOCIETE GENERALE SA	12,369,223.94	1.57
60,860.00 SODEXO SA	4,695,957.60	0.60
44,366.00 TELEPERFORMANCE SE	11,575,089.40	1.47
83,292.00 UNIBAIL RODAMCO	3,571,977.43	0.45
154,730.00 VALEO SA	2,418,429.90	0.31
499,443.00 VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	9,844,021.53	1.25
403,585.00 VINCI SA	33,566,164.45	4.26
582,328.00 VIVENDI SA	4,642,318.82	0.59
Pays-Bas	54,853,259.59	6.96
443,580.00 AIRBUS SE	39,429,826.20	5.00
13,896.00 STMICROELECTRONICS	448,146.00	0.06
464,422.00 STMICROELECTRONICS NV	14,975,287.39	1.90
Total portefeuille-titres	787,819,869.37	100.02

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	1,677,658,748.48	99.84	Italie	61,294,368.89	3.65
Actions	1,677,658,748.48	99.84	5,215,841.00 ENEL SPA	22,031,712.38	1.31
Allemagne	422,244,364.14	25.13	1,663,713.00 ENI SPA	18,151,108.83	1.08
112,948.00 ADIDAS AG NAMEN AKT	13,427,258.24	0.80	12,398,137.00 INTESA SANPAOLO	21,111,547.68	1.26
274,247.00 ALLIANZ SE REG SHS	44,373,164.60	2.64	Pays-Bas	267,990,247.18	15.95
616,686.00 BASF SE REG SHS	24,420,765.60	1.45	19,188.00 ADYEN --- PARTS SOCIALES	24,978,938.40	1.49
659,620.00 BAYER AG REG SHS	31,275,882.30	1.86	392,275.00 AIRBUS SE	34,869,324.75	2.08
215,192.00 BMW AG	15,061,288.08	0.90	272,916.00 ASML HOLDING NV	118,336,377.60	7.04
127,570.00 DEUTSCHE BOERSE AG REG SHS	21,463,652.50	1.28	2,529,405.00 ING GROUP NV	22,405,469.49	1.33
661,551.00 DEUTSCHE POST AG REG SHS	20,584,159.38	1.23	666,875.00 KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	17,428,778.16	1.04
2,328,878.00 DEUTSCHE TELEKOM AG REG SHS	40,736,733.98	2.42	579,601.00 PROSUS NV	31,281,065.97	1.86
876,823.00 INFINEON TECHNOLOGIES REG SHS	19,912,650.33	1.19	1,523,003.00 STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	18,690,292.81	1.11
528,031.00 MERCEDES-BENZ GROUP	27,642,422.85	1.65	Autres valeurs mobilières	0.00	0.00
94,065.00 MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG REG SHS	23,281,087.50	1.39	Warrants, Droits	0.00	0.00
728,419.00 SAP AG	61,274,606.28	3.64	Pays-Bas	0.00	0.00
499,940.00 SIEMENS AG REG	50,593,928.00	3.00	509,759.00 PROSUS NV RTS	0.00	0.00
138,451.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	17,500,206.40	1.04	Total portefeuille-titres	1,677,658,748.48	99.84
481,610.00 VONOVIA SE	10,696,558.10	0.64			
Belgique	27,991,934.41	1.67			
598,822.00 ANHEUSER-BUSCH INBEV	27,991,934.41	1.67			
Espagne	99,035,365.26	5.89			
4,057,441.00 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	18,747,406.15	1.12			
11,276,115.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	27,034,485.71	1.61			
3,900,438.00 IBERDROLA SA	37,373,996.92	2.21			
746,216.00 INDITEX SHARE FROM SPLIT	15,879,476.48	0.95			
Finlande	38,085,406.77	2.27			
3,622,652.00 NOKIA OYJ	16,013,933.17	0.95			
2,508,122.00 NORDEA BK	22,071,473.60	1.32			
France	637,311,282.45	37.92			
351,340.00 AIR LIQUIDE NOM. PRIME FIDELITE	41,303,530.40	2.46			
1,325,978.00 AXA SA	29,801,355.57	1.77			
763,948.00 BNP PARIBAS SA	33,311,952.55	1.98			
429,282.00 DANONE SA	20,850,226.74	1.24			
203,989.00 ESSILORLUXOTTICA SA	28,629,856.15	1.70			
1,956.00 EUROAPI SASU SHARES	33,330.24	0.00			
23,682.00 HERMES INTERNATIONAL SA	28,820,994.00	1.72			
48,841.00 KERING	22,396,040.55	1.33			
161,910.00 L OREAL-ACT REG PROV PRIM.FIDELITE 2013	53,470,777.50	3.18			
1,518.00 L'OREAL SA	501,319.50	0.03			
175,234.00 LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	106,962,833.60	6.37			
135,124.00 PERNOD RICARD SA	25,518,167.40	1.52			
254,645.00 SAFRAN SA	23,939,176.45	1.42			
771,613.00 SANOFI	60,494,459.20	3.60			
383,444.00 SCHNEIDER ELECTRIC SE	44,839,941.36	2.67			
1,758,540.00 TOTALENERGIESSE	84,893,518.51	5.05			
379,269.00 VINCI SA	31,543,802.73	1.88			
Irlande	123,705,779.38	7.36			
519,774.00 CRH PLC	17,188,926.18	1.02			
118,058.00 FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	13,340,554.00	0.79			
333,726.00 LINDE PLC	93,176,299.20	5.55			

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	899,681,993.69	100.21	1,748.00 CHARTER COMM -A-	541,270.66	0.06
Actions	899,681,993.69	100.21	20,197.00 CHEVRON CORP	2,961,979.27	0.33
Allemagne	8,181,675.42	0.91	121.00 CHIPOTLE MEXICAN GRILL -A-	185,611.15	0.02
14,682.00 COMMERZBK	107,795.24	0.01	3,755.00 CINTAS	1,487,932.88	0.17
39,436.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	301,527.66	0.03	108,044.00 CITIGROUP INC	4,595,716.31	0.51
8,361.00 SCOUT24	432,430.92	0.05	13,067.00 CME GROUP -A-	2,362,637.38	0.26
58,069.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	7,339,921.60	0.82	54.00 COCA-COLA CO	3,087.92	0.00
Autriche	7,524,087.04	0.84	82,659.00 COLGATE-PALMOLIVE CO	5,927,417.70	0.66
332,336.00 ERSTE GROUP BANK AG	7,524,087.04	0.84	36,326.00 CONAGRA BRANDS INC	1,209,939.65	0.13
Belgique	6,033,564.72	0.67	7,326.00 CONOCOPHILLIPS CO	765,317.04	0.09
47,223.00 AGEAS NOM	1,768,029.12	0.20	10,492.00 CONSTELLATION BRANDS INC -A-	2,459,860.73	0.27
87,660.00 KBC GROUPE SA	4,265,535.60	0.47	29,294.00 CONSTELLATION ENERGY	2,487,590.32	0.28
Bermudes	368,752.11	0.04	15,771.00 COOPER COMPANIES INC	4,248,422.29	0.47
31,800.00 NORVERGIAN CRUISE LINE LTD	368,752.11	0.04	3,637.00 COPART INC	395,015.36	0.04
Espagne	17,905,093.19	1.99	17,171.00 COSTCO WHOLESALE CORP	8,277,801.43	0.92
35,537.00 AENA SME SA	3,798,905.30	0.42	66,991.00 COTERRA ENERGY INC	1,786,153.14	0.20
7,618.00 AMADEUS IT GROUP SA -A-	364,978.38	0.04	123,959.00 CROWN CASTLE INC	18,290,484.82	2.04
4,885,700.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	11,713,465.75	1.30	496,377.00 CSX CORP	13,498,171.06	1.50
600,635.00 TELEFONICA SA	2,027,743.76	0.23	55,147.00 CVS HEALTH	5,368,620.82	0.60
Etats-Unis d'Amérique	629,797,874.80	70.15	35,701.00 DELTA AIR LINES	1,022,579.55	0.11
27,870.00 ABBOTT LABORATORIES	2,752,719.03	0.31	4,134.00 DEXCOM INC	339,868.69	0.04
2,243.00 ABIOMED INC	562,461.47	0.06	3,052.00 DISH NETWORK -A-	43,085.96	0.00
314,874.00 ACTIVISION BLIZZARD	23,893,975.56	2.66	98,467.00 DOMINION RESOURCES - REGISTERED	6,946,413.89	0.77
1,942.00 ADOBE INC	545,540.14	0.06	27,449.00 DOW - REGISTERED SHS	1,230,883.04	0.14
2,353.00 ALIGN TECHNOLOGY INC	497,453.00	0.06	4,905.00 DR HORTON	337,214.06	0.04
190,082.00 ALPHABET INC -A-	18,559,019.34	2.07	130,087.00 DUKE ENERGY CORP	12,352,057.10	1.38
189,982.00 ALPHABET INC -C-	18,646,219.87	2.08	6.00 DXC TECHNOLOGY	149.93	0.00
17,600.00 AMEREN CORPORATION	1,447,129.08	0.16	14,011.00 EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,181,778.11	0.13
41,901.00 AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	3,697,587.35	0.41	64,577.00 ELECTRONIC ARTS - REGISTERED	7,627,422.72	0.85
61,571.00 AMERICAN EXPRESS	8,479,093.16	0.94	34,904.00 ELI LILLY & CO	11,520,653.70	1.28
12,266.00 AMERICAN INTL	594,487.50	0.07	1,345.00 ENPHASE ENERGY	380,949.47	0.04
117,215.00 AMETEK INC	13,569,492.32	1.51	8,375.00 ENTERGY CORP	860,283.01	0.10
5,101.00 AMPHENOL -A-	348,658.15	0.04	950.00 EQUINIX INC	551,623.54	0.06
27,784.00 ANALOG DEVICES INC	3,951,842.56	0.44	7,480.00 FEDEX CORP	1,133,624.87	0.13
4,976.00 ANSYS INC	1,126,095.24	0.13	86,872.00 FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES INC	6,701,288.26	0.75
92,049.00 APA - REGISTERED SHS	3,212,530.30	0.36	55,063.00 FIRSTENERGY CORP	2,079,651.92	0.23
334,595.00 APPLE INC	47,201,581.18	5.25	2,492.00 FREEPORT MCMORAN COPPER AND GOLD INC	69,521.11	0.01
13,432.00 APPLIED MATERIALS INC	1,123,343.81	0.13	2,025.00 F5 --- REGISTERED SHS	299,166.28	0.03
2,022.00 ARISTA NETWORKS INC	233,005.24	0.03	30,874.00 GENERAL MILLS INC	2,414,389.98	0.27
586.00 ARTHUR J.GALLAGHER AN CO	102,419.15	0.01	124,962.00 GENERAL MOTORS CO	4,093,329.84	0.46
31,965.00 AT&T INC	500,528.86	0.06	12,459.00 GLOBE LIFE INC	1,267,965.40	0.14
1,907.00 AUTOZONE INC	4,169,510.04	0.46	24,944.00 GOLDMAN SACHS GROUP INC	7,461,684.48	0.83
8,891.00 AVERY DENNISON CORP	1,476,614.81	0.16	75,059.00 HALLIBURTON	1,886,339.59	0.21
3,516.00 BANK OF NY MELLON	138,249.70	0.02	18,481.00 HERSHEY	4,159,144.66	0.46
71,010.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	19,354,963.71	2.16	1,526.00 HOLOGIC INC	100,502.75	0.01
1,689.00 BIO RAD LABORATORIES -A-	719,184.87	0.08	49,807.00 HOME DEPOT INC	14,029,238.59	1.56
369.00 BIOGEN IDEC INC	100,569.59	0.01	1,637.00 HONEYWELL INTERNATIONAL INC	279,007.70	0.03
9,933.00 BOSTON SCIENTIF CORP	392,696.46	0.04	2,925.00 HUMANA INC	1,448,661.00	0.16
18,910.00 CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	3,154,658.60	0.35	8,737.00 IDEX CORP	1,782,360.49	0.20
24,486.00 CATERPILLAR - REGISTERED	4,101,120.69	0.46	29,383.00 ILLUMINA INC	5,722,434.10	0.64
9,121.00 CDW	1,453,177.85	0.16	5,143.00 INCYTE CORP	349,848.95	0.04
13,777.00 CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,353,581.64	0.15	304,732.00 INTEL CORP	8,016,070.68	0.89
			17,256.00 INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,591,465.93	0.18
			4,362.00 IPG PHOTONICS CORP	375,577.71	0.04
			27,533.00 JOHNSON & JOHNSON	4,591,222.25	0.51
			3,392.00 KELLOGG CO	241,195.04	0.03
			6,835.00 KEYSIGHT TECHNOLOGIES	1,097,897.82	0.12

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets		
	EUR			EUR			
19,485.00	KIMBERLY-CLARK CORP	2,238,393.20	0.25	1,273.00	UNION PACIFIC CORP	253,157.62	0.03
113,086.00	KINDER MORGAN INC	1,920,840.14	0.21	7,355.00	UNITED RENTALS INC	2,028,002.45	0.23
100,836.00	KROGER CO	4,503,215.43	0.50	22,901.00	UNITEDHEALTH GROUP INC	11,806,176.74	1.32
2,292.00	LAM RESEARCH CORP	856,297.66	0.10	146,638.00	VERIZON COMMUNICATIONS INC	5,683,504.17	0.63
2,212.00	LINCOLN NATIONAL CORP	99,146.55	0.01	35,840.00	VULCAN MATERIALS CO	5,769,740.62	0.64
78,189.00	MARATHON PETROLEUM	7,927,845.02	0.88	4,484.00	WARNER BROS DISCOVERY INC	52,637.17	0.01
1,965.00	MARKETAXESS HOLDING INC	446,274.54	0.05	3.00	WASTE MANAGEMENT	490.61	0.00
857.00	MARRIOTT INTERNATIONAL -A-	122,594.78	0.01	5,493.00	WATERS	1,511,282.90	0.17
1,220.00	MARSH MCLENNAN COS	185,917.22	0.02	15,937.00	WEC ENERGY GR	1,454,852.15	0.16
3,958.00	MCDONALD'S CORP	932,240.00	0.10	11,622.00	WELLS FARGO AND CO	477,146.78	0.05
97,924.00	META PLATFORMS INC A	13,562,321.56	1.51	744.00	WW GRAINGER INC	371,517.75	0.04
132.00	METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	146,076.50	0.02	5,509.00	WYNN RESORTS LTD	354,445.23	0.04
6,869.00	MICROSOFT CORP	1,633,022.10	0.18	36,056.00	YUM BRANDS INC	3,913,841.72	0.44
2,135.00	MOLINA HEALTHCARE	718,836.73	0.08		France	116,955,288.61	13.03
184,706.00	MORGAN STANLEY	14,896,770.34	1.66	4,589.00	ACCOR SA	99,168.29	0.01
15,928.00	NETFLIX INC	3,827,987.87	0.43	67,848.00	AIR LIQUIDE NOM. PRIME FIDELITE	7,976,210.88	0.89
118,456.00	NEWMONT CORPORATION	5,082,126.96	0.57	88,000.00	AIR LIQUIDE SA	10,345,280.00	1.15
86,013.00	NEWS CORP -A-	1,326,653.84	0.15	652,385.00	AXA SA	14,662,352.88	1.63
71,541.00	NEXTERA ENERGY	5,726,055.03	0.64	28,000.00	DANONE SA	1,359,960.00	0.15
199,153.00	NIKE INC	16,897,460.68	1.88	164,226.00	ENGIE --- REGISTERED LOYALTY BONUS	1,944,764.29	0.22
40,000.00	NISOURCE	1,028,530.60	0.11	58,643.00	ESSILORLUXOTTICA SA	8,230,545.05	0.92
391.00	NVR INC	1,591,331.88	0.18	73,999.00	L OREAL-ACT REG PROV PRIM.FIDELITE 2013	24,438,169.75	2.73
11,116.00	ORACLE CORP	692,955.77	0.08	30,467.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	18,597,056.80	2.07
15,603.00	ORGANON --- REGISTERED SHS	372,694.53	0.04	134,363.00	ORANGE	1,242,589.02	0.14
11,417.00	OTIS WORLDWIDE CORPORATION	743,535.55	0.08	54,205.00	SANOFI	4,249,672.00	0.47
4,818.00	PAYCOM SOFTWARE INC	1,622,918.21	0.18	493,206.00	TOTALENERGIESSE	23,809,519.65	2.65
3.00	PAYPAL HOLDINGS	263.57	0.00		FR-Curacao	1,156,173.12	0.13
89,502.00	PEPSICO INC	14,915,629.58	1.66	31,550.00	SCHLUMBERGER LTD	1,156,173.12	0.13
56,514.00	PFIZER INC	2,524,424.68	0.28		Irlande	26,764,534.49	2.98
6,073.00	PROCTER & GAMBLE CO	782,643.04	0.09	13,976.00	ACCENTURE - SHS CLASS A	3,670,724.03	0.41
9,590.00	PROGRESSIVE CORP	1,137,604.14	0.13	5,898.00	AON - REGISTERED SHS (USD)	1,612,716.03	0.18
12,127.00	PTC INC	1,294,834.07	0.14	75,074.00	LINDE PLC	20,659,622.99	2.30
20,395.00	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	1,170,633.24	0.13	9,966.00	MEDTRONIC HLD	821,471.44	0.09
14,472.00	PUBLIC STORAGE INC	4,325,571.70	0.48		Japon	12,368,010.02	1.38
12,085.00	QORVO INC	979,604.81	0.11	301,000.00	NAGOYA RAIL ROAD CO. LTD.	4,720,922.66	0.53
24,942.00	QUALCOMM INC	2,876,483.60	0.32	986,400.00	TOHOKU ELECTRIC POWER	4,737,244.30	0.53
33,303.00	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORPORATION	2,782,813.84	0.31	48,600.00	TSURUHA HOLDINGS INC	2,909,843.06	0.32
3,686.00	ROSS STORES INC	317,071.63	0.04		Luxembourg	16.85	0.00
32,243.00	SALESFORCE INC	4,734,173.55	0.53	3.00	SES GLOBAL CERT.GC FID.DEP.REC(1-A-SHS)	16.85	0.00
90,241.00	SEALED AIR	4,100,063.20	0.46		Pays-Bas	8,968,918.24	1.00
15,486.00	SHERWIN WILLIAMS CO	3,236,623.79	0.36	593,971.00	ING GROUP NV	5,261,395.12	0.59
44,193.00	SOUTHERN CO	3,067,548.61	0.34	68,696.00	PROSUS NV	3,707,523.12	0.41
265,018.00	SOUTHWEST AIRLINES CO - REGISTERED	8,342,933.82	0.93		Royaume-Uni	35,651,073.87	3.97
39,296.00	SYNCHRONY FINANCIAL	1,130,765.31	0.13	78,935.00	NIELSEN HOLDINGS PLC	2,233,530.55	0.25
178.00	SYNOPSIS	55,510.42	0.01	1,274,280.00	SHELL PLC	32,666,167.80	3.64
26,439.00	SYSCO CORP	1,908,336.33	0.21	16,616.00	UNILEVER	751,375.52	0.08
7,133.00	TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	793,647.73	0.09		Suisse	28,006,931.21	3.12
10,817.00	TELEFLEX INC	2,224,460.59	0.25	17,400.00	BALOISE HOLDING REG.SHS	2,286,434.35	0.25
243,306.00	TEXAS INSTRUMENTS INC	38,441,180.71	4.27	296.00	BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	573,764.78	0.06
75,391.00	THE HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	4,766,721.32	0.53	279.00	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP PARTIZIPSCH	2,766,272.56	0.31
32,734.00	THERMO FISHER SCIENT SHS	16,947,233.67	1.89	10,298.00	CHUBB - NAMEN AKT	1,911,907.56	0.21
7,430.00	TRAVELERS COS INC/THE	1,161,921.09	0.13	4,323.00	EMS-CHEM HOLDINGS-NAMEN ACT.	2,817,885.81	0.31
19,302.00	TRIMBLE	1,069,279.38	0.12				
6,942.00	TWITTER INC	310,659.19	0.03				
39,588.00	UDR	1,685,515.73	0.19				
87.00	ULTA BEAUTY RG REGISTERED	35,628.57	0.00				
24.00	UNDER ARMOUR INC -A-	162.92	0.00				

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR	
24,705.00 HELVETIA HLDG - REGISTERED SHS	2,380,309.58	0.27
17.00 LONZA GROUP (CHF)	8,574.05	0.00
43,033.00 NOVARTIS AG REG SHS	3,370,962.96	0.38
202.00 PARTNERS GROUP HLDG NAMEN AKT	168,563.78	0.02
4,955.00 PSP SWISS PROPERTY AG	508,758.56	0.06
7,608.00 ROCHE HOLDING LTD	2,552,175.48	0.28
1,019.00 SGS SA REG SHS	2,245,773.70	0.25
6,325.00 SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	2,876,490.87	0.32
5,263.00 SWISSCOM SHS NOM	2,529,973.55	0.28
2,819.00 TE CONNECTIVITY LTD REG SHS	317,567.34	0.04
1,688.00 ZURICH INSURANCE GROUP NAMENSAKT	691,516.28	0.08
Total portefeuille-titres	899,681,993.69	100.21

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	236,500,356.34	99.83	19,478.00 HONEYWELL INTERNATIONAL INC	3,319,799.58	1.40
Actions	236,500,356.34	99.83	19,985.00 HORMEL FOODS CORP	926,982.49	0.39
Allemagne	9,219,393.80	3.89	4,017.00 HUMANA INC	1,989,494.44	0.84
11,773.00 ALLIANZ SE REG SHS	1,904,871.40	0.80	1,173.00 ILLUMINA INC	228,445.54	0.10
26,128.00 PORSCHE AUTOMOBIL HLDG - VORZ.AKT-STIMMR	1,519,604.48	0.64	49,410.00 INTEL CORP	1,299,745.52	0.55
37,675.00 RWE AG	1,423,738.25	0.60	7,049.00 INTUIT	2,786,932.76	1.18
383,942.00 SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	4,371,179.67	1.85	8.00 KEYSIGHT TECHNOLOGIES	1,285.03	0.00
Espagne	37,374,874.65	15.78	6,262.00 KIMBERLY-CLARK CORP	719,364.55	0.30
13,205.00 AMADEUS IT GROUP SA -A-	632,651.55	0.27	22,342.00 LINCOLN NATIONAL CORP	1,001,416.04	0.42
5,703,741.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	13,674,719.05	5.78	9,667.00 LOWE'S CO INC	1,853,273.38	0.78
60,352.00 ENDESA	930,627.84	0.39	4,139.00 MARATHON PETROLEUM	419,667.10	0.18
273,523.00 GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA SA	4,902,899.78	2.07	9,039.00 MARKETAXESS HOLDING INC	2,052,862.87	0.87
582,095.00 RED ELECTRICA	9,144,712.45	3.86	7,230.00 MARSH MCLENNAN COS	1,101,788.09	0.47
2,396,109.00 TELEFONICA SA	8,089,263.98	3.41	28,178.00 META PLATFORMS INC A	3,902,609.14	1.65
Etats-Unis d'Amérique	140,851,164.96	59.45	407.00 METLIFE INC	25,251.32	0.01
37,768.00 ABBOTT LABORATORIES	3,730,344.18	1.57	976.00 MICROCHIP TECHNOLOGY	60,802.61	0.03
1.00 ADOBE INC	280.92	0.00	4,051.00 MICROSOFT CORP	963,076.51	0.41
3,871.00 AKAMAI TECHNOLOGIES	317,377.35	0.13	20,374.00 MORGAN STANLEY	1,643,188.63	0.69
186,257.00 ALPHABET INC -A-	18,185,558.16	7.67	3,784.00 NETFLIX INC	909,411.48	0.38
64,480.00 ALPHABET INC -C-	6,328,537.74	2.67	15,216.00 NIKE INC	1,291,026.31	0.54
2,751.00 AMERICAN EXPRESS	378,846.95	0.16	19,191.00 OTIS WORLDWIDE CORPORATION	1,249,819.63	0.53
65,510.00 AMERICAN INTL	3,175,026.59	1.34	24,001.00 PAYCHEX INC	2,749,096.32	1.16
690.00 AMPHENOL -A-	47,162.15	0.02	459.00 SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	108,447.04	0.05
4,356.00 ANSYS INC	985,785.94	0.42	9,134.00 SOUTHERN CO	634,014.19	0.27
24,848.00 A.O.SMITH CORP	1,232,190.93	0.52	4,391.00 TELEFLEX INC	902,986.64	0.38
104,969.00 APPLE INC	14,808,059.82	6.24	76,485.00 TERADYNE INC	5,867,246.21	2.48
81,149.00 AT&T INC	1,270,684.08	0.54	2,430.00 THERMO FISHER SCIENT SHS	1,258,073.50	0.53
4,724.00 AUTODESK INC	900,773.95	0.38	353.00 UDR	15,029.48	0.01
5,385.00 AVERY DENNISON CORP	894,339.30	0.38	11,076.00 ULTA BEAUTY RG REGISTERED	4,535,885.71	1.91
56,111.00 BANK OF AMERICA CORP	1,729,752.67	0.73	8.00 UNDER ARMOUR INC -A-	54.31	0.00
10,095.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	2,751,561.17	1.16	25,658.00 UNION PACIFIC CORP	5,102,528.00	2.15
505.00 BIOGEN IDEC INC	137,635.89	0.06	1.00 UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	33.21	0.00
9,464.00 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	686,771.56	0.29	1,452.00 UNITED RENTALS INC	400,361.60	0.17
10,158.00 CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	1,694,607.20	0.72	7.00 WASTE MANAGEMENT	1,144.77	0.00
1,288.00 CENTENE CORP	102,301.11	0.04	11,422.00 WEC ENERGY GR	1,042,688.16	0.44
140.00 CHIPOTLE MEXICAN GRILL -A-	214,756.70	0.09	4,473.00 WELLS FARGO AND CO	183,641.16	0.08
2,341.00 CINTAS	927,630.06	0.39	3,132.00 ZEBRA TECHNOLOGIES -A-	837,661.74	0.35
31,378.00 COCA-COLA CO	1,794,309.76	0.76	Finlande	8,717,517.12	3.68
4,970.00 COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS -A-	291,406.93	0.12	199,212.00 SAMPO OYJ -A-	8,717,517.12	3.68
51,815.00 COLGATE-PALMOLIVE CO	3,715,616.55	1.57	France	822,936.00	0.35
3,296.00 COSTCO WHOLESALE CORP	1,588,936.78	0.67	88.00 L OREAL-ACT REG PROV PRIM.FIDELITE 2013	29,062.00	0.01
26,705.00 CSX CORP	726,199.36	0.31	82.00 LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	50,052.80	0.02
501.00 DOW - REGISTERED SHS	22,466.12	0.01	15,408.00 TOTALENERGIESSE	743,821.20	0.32
20,861.00 DXC TECHNOLOGY	521,285.44	0.22	Panama	93.29	0.00
1,740.00 EBAY INC	65,379.88	0.03	13.00 CARNIVAL CORP	93.29	0.00
2,444.00 EDWARDS LIFESCIENCES CORP	206,142.72	0.09	Pays-Bas	10,027,201.53	4.23
16,038.00 ELECTRONIC ARTS - REGISTERED	1,894,306.11	0.80	13,290.00 ASML HOLDING NV	5,762,544.00	2.43
12,525.00 EXPEDIA GROUP INC	1,197,843.36	0.51	481,447.00 ING GROUP NV	4,264,657.53	1.80
19,995.00 EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	1,802,438.06	0.76	Royaume-Uni	13,475,114.85	5.69
1,794.00 GENERAL MOTORS CO	58,765.33	0.02	178.00 RELX PLC	4,460.68	0.00
1,257.00 GOLDMAN SACHS GROUP INC	376,015.77	0.16	525,479.00 SHELL PLC	13,470,654.17	5.69
8.00 HOLOGIC INC	526.88	0.00	Suisse	16,012,060.14	6.76
52,204.00 HOME DEPOT INC	14,704,406.43	6.20	92.00 LONZA GROUP (CHF)	46,400.75	0.02

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR	
31,783.00 NESTLE SA REG SHS	3,529,686.41	1.49
158,755.00 NOVARTIS AG REG SHS	12,435,972.98	5.25
Total portefeuille-titres	236,500,356.34	99.83

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	USD	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	6,707,862.17	99.35
Actions	6,707,862.17	99.35
Allemagne	1,718,520.84	25.45
375.00 ALLIANZ SE REG SHS	59,440.26	0.88
23,430.00 COMMERZBK	168,522.39	2.50
69,006.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	516,882.82	7.66
5,183.00 PORSCHE AUTOMOBIL HLDG - VORZ.AKT-STIMMR	295,308.91	4.37
3,202.00 RWE AG	118,541.16	1.76
4,521.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	559,825.30	8.28
Autriche	217,512.16	3.22
9,807.00 ERSTE GROUP BANK AG	217,512.16	3.22
Belgique	304,469.11	4.51
2,118.00 COFINIMMO SA	175,951.41	2.61
2,696.00 KBC GROUPE SA	128,517.70	1.90
Etats-Unis d'Amérique	759,774.31	11.25
61.00 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	4,336.49	0.06
263.00 CSX CORP	7,006.32	0.10
950.00 ILLUMINA INC	181,250.50	2.68
228.00 META PLATFORMS INC A	30,935.04	0.46
6,643.00 PHILLIPS 66	536,222.96	7.95
2.00 WARNER BROS DISCOVERY INC	23.00	0.00
France	715,924.68	10.60
3,146.00 SANOFI	241,627.15	3.58
10,029.00 TOTALENERGIESSE	474,297.53	7.02
Luxembourg	299,084.12	4.43
17,492.00 SES GLOBAL CERT.GC FID.DEP.REC(1-A-SHS)	96,270.26	1.43
15,607.00 TENARIS SA - REG.SHS	202,813.86	3.00
Pays-Bas	851,983.68	12.62
5,177.00 AIRBUS SE	450,818.80	6.68
27,175.00 ING GROUP NV	235,817.58	3.49
10.00 KONINKLIJKE KPN NV	27.16	0.00
784.00 ROYAL PHILIPS NV	12,288.73	0.18
12,729.00 STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	153,031.41	2.27
Royaume-Uni	923,958.50	13.69
12,975.00 RELX PLC	318,536.63	4.73
12,594.00 SHELL PLC	316,277.25	4.68
6,527.00 UNILEVER	289,144.62	4.28
Suisse	916,634.77	13.58
221.00 LONZA GROUP (CHF)	109,194.40	1.62
15.00 NESTLE SA REG SHS	1,631.94	0.02
4,205.00 NOVARTIS AG REG SHS	322,692.82	4.78
963.00 ROCHE HOLDING LTD	316,473.43	4.69
2,432.00 TEMENOS AG NAM.AKT	166,642.18	2.47
Total portefeuille-titres	6,707,862.17	99.35

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	74,787,067.82	99.66	118,538.00 VIVENDI SA	944,984.94	1.26
Actions	74,787,067.82	99.66	Irlande	1,294,067.74	1.72
Allemagne	5,786,325.31	7.71	222.00 ACCENTURE - SHS CLASS A	58,307.15	0.08
1,999.00 ALLIANZ SE REG SHS	323,438.20	0.43	1,229.00 LINDE PLC	338,208.66	0.45
9,135.00 BAYER AG REG SHS	433,136.03	0.58	10,889.00 MEDTRONIC HLD	897,551.93	1.19
32,220.00 COMMERZBK	236,559.24	0.32	Luxembourg	23,533.80	0.03
329,957.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	2,522,851.22	3.35	4,189.00 SES GLOBAL CERT.GC FID.DEP.REC(1-A-SHS)	23,533.80	0.03
67,195.00 FRESENIUS SE	1,474,930.25	1.97	Panama	14.35	0.00
173.00 PORSCHE AUTOMOBIL HLDG - VORZ.AKT-STIMMR	10,061.68	0.01	2.00 CARNIVAL CORP	14.35	0.00
68,981.00 SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	785,348.69	1.05	Pays-Bas	31,349,439.13	41.79
Autriche	1,238,838.16	1.65	1,633,683.00 AEGON NV	6,701,367.67	8.93
54,719.00 ERSTE GROUP BANK AG	1,238,838.16	1.65	33,709.00 AIRBUS SE	2,996,393.01	3.99
Belgique	3,896,683.44	5.19	2,695.00 ASML HOLDING NV	1,168,552.00	1.56
10,344.00 AGEAS NOM	387,279.36	0.52	1,618.00 FERRARI NV	310,170.60	0.41
4,979.00 GROUPE BRUXELLES LAMBERT GBL	357,890.52	0.48	20,426.00 HEINEKEN NV	1,835,480.36	2.45
64,766.00 KBC GROUPE SA	3,151,513.56	4.19	488,243.00 ING GROUP NV	4,324,856.49	5.76
Etats-Unis d'Amérique	12,944,228.97	17.25	107,312.00 KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	2,804,599.12	3.74
5,104.00 ALPHABET INC -A-	498,338.79	0.66	77,158.00 KONINKLIJKE KPN NV	213,881.98	0.29
6,818.00 ALPHABET INC -C-	669,168.27	0.89	37,795.00 NN GROUP NV	1,510,666.15	2.01
3,809.00 AMERICAN EXPRESS	524,546.72	0.70	156,019.00 ROYAL PHILIPS NV	2,496,304.00	3.33
1,577.00 APPLE INC	222,468.64	0.30	569,173.00 STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	6,987,167.75	9.32
27,542.00 BANK OF AMERICA CORP	849,046.50	1.13	Royaume-Uni	678,763.87	0.90
3,708.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	1,010,677.45	1.35	831.00 RELX PLC	20,824.86	0.03
45,130.00 CITIGROUP INC	1,919,631.60	2.56	19,407.00 SHELL PLC	497,498.45	0.66
4,845.00 CME GROUP -A-	876,021.90	1.17	3,548.00 UNILEVER	160,440.56	0.21
12.00 COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS -A-	703.60	0.00	Suisse	359,953.55	0.48
1,098.00 COSTCO WHOLESALE CORP	529,324.21	0.71	1,535.00 CHUBB - NAMEN AKT	284,985.25	0.38
4,101.00 HONEYWELL INTERNATIONAL INC	698,967.97	0.93	62.00 SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	28,196.43	0.04
14,422.00 INTEL CORP	379,375.23	0.51	1.00 TEMENOS AG NAM.AKT	69.94	0.00
5,625.00 NIKE INC	477,262.29	0.64	114.00 ZURICH INSURANCE GROUP NAMENSAKT	46,701.93	0.06
6,619.00 PAYPAL HOLDINGS	581,531.50	0.77	Total portefeuille-titres	74,787,067.82	99.66
1,109.00 PUBLIC STORAGE INC	331,471.74	0.44			
12,265.00 REGIONS FINANCIAL CORP	251,271.93	0.33			
1.00 SYNOPSIS	311.86	0.00			
657.00 TESLA MOTORS INC	177,889.30	0.24			
3,723.00 THERMO FISHER SCIENT SHS	1,927,492.85	2.56			
1.00 UNDER ARMOUR INC -A-	6.79	0.00			
6,328.00 VULCAN MATERIALS CO	1,018,719.83	1.36			
Finlande	459,254.40	0.61			
52,188.00 NORDEA BK	459,254.40	0.61			
France	16,755,965.10	22.33			
3,777.00 ACCOR SA	81,620.97	0.11			
108,078.00 AXA SA	2,429,053.05	3.24			
76,402.00 CARREFOUR SA	1,086,054.43	1.45			
109,817.00 ENGIE --- REGISTERED LOYALTY BONUS	1,300,452.91	1.73			
12,370.00 L OREAL-ACT REG PROV PRIM.FIDELITE 2013	4,085,192.50	5.43			
110,837.00 ORANGE	1,025,020.58	1.37			
22,752.00 RENAULT SA	636,373.44	0.85			
23,797.00 SANOFI	1,865,684.80	2.49			
36,130.00 SOCIETE GENERALE SA	737,593.95	0.98			
53,111.00 TOTALENERGIESSE	2,563,933.53	3.42			

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	16,811,118.73	100.12
Actions	16,811,118.73	100.12
Allemagne	2,482,285.20	14.78
8,329.00 ALLIANZ SE REG SHS	1,347,632.20	8.02
18,330.00 COMMERZBK	134,578.86	0.80
30,864.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	235,986.14	1.41
6,045.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	764,088.00	4.55
Belgique	245,656.96	1.46
6,054.00 AGEAS NOM	226,661.76	1.35
224.00 COFINIMMO SA	18,995.20	0.11
Espagne	4,522,106.42	26.94
323,392.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	775,332.32	4.62
42,979.00 ENDESA	662,736.18	3.95
24,584.00 FERROVIAL SA	575,019.76	3.42
20,733.00 INDITEX SHARE FROM SPLIT	441,198.24	2.63
124,636.00 REPSOL SA	1,471,327.98	8.77
176,686.00 TELEFONICA SA	596,491.94	3.55
Etats-Unis d'Amérique	2,231,318.75	13.29
12.00 ALPHABET INC -A-	1,171.64	0.01
9,463.00 ALPHABET INC -C-	928,767.88	5.54
25,350.00 BANK OF AMERICA CORP	781,472.98	4.65
704.00 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	51,086.98	0.30
1,972.00 MICROSOFT CORP	468,819.27	2.79
France	1,848,785.73	11.01
2,837.00 L OREAL-ACT REG PROV PRIM.FIDELITE 2013	936,919.25	5.58
18,889.00 TOTALENERGIESE	911,866.48	5.43
Luxembourg	550,912.89	3.28
54,723.00 SES GLOBAL CERT.GC FID.DEP.REC(1-A-SHS)	307,433.81	1.83
18,355.00 TENARIS SA - REG.SHS	243,479.08	1.45
Pays-Bas	1,001,017.83	5.96
5,676.00 AIRBUS SE	504,539.64	3.00
56,047.00 ING GROUP NV	496,464.33	2.96
5.00 KONINKLIJKE KPN NV	13.86	0.00
Royaume-Uni	1,744,504.02	10.39
32,172.00 SHELL PLC	824,729.22	4.91
20,340.00 UNILEVER	919,774.80	5.48
Suisse	2,184,530.93	13.01
17.00 BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	32,952.71	0.20
1,890.00 NESTLE SA REG SHS	209,895.46	1.25
5,389.00 NOVARTIS AG REG SHS	422,143.92	2.51
2,263.00 ROCHE HOLDING LTD	759,144.73	4.52
1,672.00 SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	760,394.11	4.53
Total portefeuille-titres	16,811,118.73	100.12

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	1,817,658,171.60	98.38			
Actions	1,817,658,171.60	98.38			
Allemagne	16,899,087.68	0.91			
98,687.00 ALLIANZ SE REG SHS	15,967,556.60	0.86	6,896.00 CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	1,150,424.42	0.06
29,631.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	226,558.63	0.01	67,989.00 CAMDEN PROPERTY SBI	8,289,987.29	0.45
18,655.00 RWE AG	704,972.45	0.04	305,512.00 CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	28,743,981.05	1.56
Autriche	498,713.92	0.03	383.00 CARMAX INC	25,810.91	0.00
22,028.00 ERSTE GROUP BANK AG	498,713.92	0.03	7,336.00 CATERPILLAR - REGISTERED	1,228,694.82	0.07
Belgique	4,201,742.34	0.23	130,554.00 CBOE HOLDINGS INC	15,641,426.00	0.85
86,349.00 KBC GROUPE SA	4,201,742.34	0.23	36,632.00 CDW	5,836,291.08	0.32
Bermudes	1,169,880.59	0.06	17,301.00 CENTENE CORP	1,374,154.86	0.07
2,818.00 EVEREST REINSURANCE GROUP	754,918.51	0.04	47,199.00 CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,637,272.24	0.25
35,785.00 NORVERGIAN CRUISE LINE LTD	414,962.08	0.02	2,661.00 CHARTER COMM -A-	823,982.39	0.04
Espagne	67,357,854.38	3.65	91,295.00 CHEVRON CORP	13,388,815.04	0.72
5,705,875.00 REPSOL SA	67,357,854.38	3.65	396.00 CHIPOTLE MEXICAN GRILL -A-	607,454.66	0.03
Etats-Unis d'Amérique	1,355,495,218.94	73.36	248,069.00 C.H.ROBINSON WORLWIDE INC	24,387,817.48	1.32
29,320.00 ABBOTT LABORATORIES	2,895,935.49	0.16	331,232.00 CITIGROUP INC	14,089,151.68	0.76
153,389.00 ABBVIE INC	21,013,972.02	1.14	11,677.00 CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	409,556.19	0.02
423.00 ABIOMED INC	106,072.76	0.01	44,451.00 CLOROX CO	5,825,615.16	0.32
11,277.00 ACTIVISION BLIZZARD	855,746.62	0.05	58,341.00 CME GROUP -A-	10,548,605.45	0.57
50,612.00 ADOBE INC	14,217,753.69	0.77	157,134.00 CMS ENERGY CORP	15,741,585.42	0.85
1,536.00 ADVANCED MICRO DEVICES INC	99,342.58	0.01	92,830.00 COCA-COLA CO	5,308,361.76	0.29
5,836.00 ALEXANDRIA REAL ESTATE	835,144.02	0.05	8,316.00 COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS -A-	487,593.57	0.03
308,098.00 ALLIANT ENERGY CORP	16,665,250.88	0.90	35,345.00 CONSOLIDATED EDISON INC	3,094,153.22	0.17
3,350.00 ALLSTATE CORP	425,841.37	0.02	33,779.00 CONSTELLATION BRANDS INC -A-	7,919,523.01	0.43
238,521.00 ALPHABET INC -A-	23,288,453.68	1.26	7,446.00 COOPER COMPANIES INC	2,005,817.79	0.11
22,219.00 AMERICAN WATER WORKS CO INC	2,952,100.28	0.16	26,237.00 COPART INC	2,849,606.29	0.15
21.00 AMEREN CORPORATION	1,726.69	0.00	19,036.00 CORNING INC	563,900.09	0.03
25,934.00 AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	2,288,566.63	0.12	66,844.00 COSTCO WHOLESALE CORP	32,224,177.90	1.74
67,588.00 AMERICAN INTL	3,275,739.54	0.18	80,419.00 CROWN CASTLE INC	11,866,040.37	0.64
23,750.00 AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,108,112.59	0.33	153,161.00 CSX CORP	4,164,966.10	0.23
5,162.00 AMERISOURCEBERGEN CORP	713,084.73	0.04	1,324.00 CUMMINS - REGISTERED	275,044.39	0.01
125,700.00 AMPHENOL -A-	8,591,713.37	0.47	302,591.00 CVS HEALTH	29,457,565.12	1.59
9,512.00 ANALOG DEVICES INC	1,352,934.29	0.07	15,671.00 DARDEN RESTAURANTS INC	2,020,681.59	0.11
2,000.00 ANSYS INC	452,610.63	0.02	347,885.00 DELTA AIR LINES	9,964,429.23	0.54
49,070.00 APPLE INC	6,922,343.69	0.37	490.00 DEXCOM INC	40,284.39	0.00
60,470.00 APPLIED MATERIALS INC	5,057,221.56	0.27	1,968.00 DIAMONDBACK ENERGY	241,989.77	0.01
8,636.00 ARISTA NETWORKS INC	995,169.74	0.05	56,155.00 DOMINION RESOURCES - REGSITERED	3,961,488.34	0.21
11,803.00 ARTHUR J.GALLAGHER AN CO	2,062,889.46	0.11	54,181.00 DOVER CORP	6,447,630.26	0.35
271,169.00 AT&T INC	4,246,141.44	0.23	168,601.00 DUKE ENERGY CORP	16,009,049.17	0.87
3,478.00 AUTODESK INC	663,186.24	0.04	34,562.00 DXC TECHNOLOGY	863,653.10	0.05
4,000.00 AUTOZONE INC	8,745,694.89	0.47	325,345.00 EDISON INTERNATIONAL	18,790,404.84	1.02
2,073.00 AVERY DENNISON CORP	344,283.26	0.02	22,799.00 EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,923,014.72	0.10
14,165.00 BANK OF AMERICA CORP	436,669.22	0.02	11,321.00 ELI LILLY & CO	3,736,686.93	0.20
415,132.00 BANK OF NY MELLON	16,323,058.89	0.88	14,778.00 EMERSON ELECTRIC CO	1,104,522.19	0.06
546,884.00 BAXTER INTERNATIONAL INC	30,067,036.43	1.63	4,430.00 ENPHASE ENERGY	1,254,725.77	0.07
39,285.00 BECTON DICKINSON	8,935,718.42	0.48	25,581.00 ENTERGY CORP	2,627,689.51	0.14
11,694.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	3,187,395.38	0.17	76.00 EPAM SYSTEMS	28,098.24	0.00
14,357.00 BLACKROCK INC	8,064,482.17	0.44	25,194.00 EXPEDIA GROUP INC	2,409,458.34	0.13
441,645.00 BOSTON SCIENTIF CORP	17,460,226.46	0.95	1,541.00 FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	629,377.34	0.03
77,117.00 BROADCOM INC - REGISTERED SHS	34,951,992.21	1.88	20,482.00 FEDEX CORP	3,104,131.62	0.17
10,419.00 BROWN AND BROWN INC	643,230.87	0.03	439,396.00 FOX CORP -A-	13,760,699.52	0.74
			17,058.00 FOX CORP -B-	496,251.72	0.03
			246,649.00 FREEPORT MCMORAN COPPER AND GOLD INC	6,880,944.39	0.37
			37,702.00 GENERAL MILLS INC	2,948,349.12	0.16
			69,375.00 GENERAL MOTORS CO	2,272,488.90	0.12
			47,969.00 GOLDMAN SACHS GROUP INC	14,349,324.20	0.78
			112,375.00 HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,629,137.96	0.14
			30,227.00 HERSHEY	6,802,579.18	0.37
			12,172.00 HOLOGIC INC	801,651.04	0.04

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets		
	EUR			EUR			
2,352.00	HOME DEPOT INC	662,492.60	0.04	298,797.00	PROLOGIS	30,988,388.91	1.68
4,751.00	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	809,752.94	0.04	9,307.00	PTC INC	993,734.70	0.05
165,614.00	HP INC	4,212,832.01	0.23	3,070.00	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	176,212.01	0.01
5,546.00	HUMANA INC	2,746,760.31	0.15	4,762.00	PUBLIC STORAGE INC	1,423,325.90	0.08
17,902.00	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIES INC	4,047,662.94	0.22	13,157.00	QORVO INC	1,066,500.66	0.06
5,351.00	ILLUMINA INC	1,042,124.52	0.06	152,351.00	QUALCOMM INC	17,570,168.92	0.95
16,194.00	INCYTE CORP	1,101,585.42	0.06	78,584.00	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORPORATION	6,566,514.82	0.36
201,695.00	INTEL CORP	5,305,650.13	0.29	2,115.00	RESMED	471,295.36	0.03
15,097.00	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,392,348.24	0.08	75,800.00	SALESFORCE INC	11,129,558.52	0.60
2,598.00	INTERNATIONAL PAPER CO	84,067.37	0.00	6,489.00	SERVICENOW INC	2,501,210.93	0.14
40,969.00	INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	1,070,592.97	0.06	172,304.00	SOUTHERN CO	11,960,059.20	0.65
19,538.00	INTUIT	7,724,654.89	0.42	9,813.00	SOUTHWEST AIRLINES CO - REGISTERED	308,919.43	0.02
4,696.00	INTUITIVE SURGICAL	898,502.77	0.05	394.00	S&P GLOBAL INC	122,807.02	0.01
2,868.00	IQVIA HOLDINGS INC	530,301.15	0.03	537,312.00	SYNCHRONY FINANCIAL	15,461,466.12	0.84
15,875.00	J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	2,534,749.66	0.14	138.00	SYNOPSIS	43,036.17	0.00
77,493.00	J.M. SMUCKER CO SHS	10,869,507.61	0.59	28,102.00	SYSCO CORP	2,028,369.74	0.11
380,665.00	JOHNSON & JOHNSON	63,477,195.32	3.43	927.00	TELEDYNE TECHNOLOGIES	319,333.12	0.02
526,625.00	KEYCORP	8,611,782.27	0.47	14,482.00	TELEFLEX INC	2,978,149.05	0.16
6,237.00	KEYSIGHT TECHNOLOGIES	1,001,841.80	0.05	39,000.00	TERADYNE INC	2,991,731.74	0.16
31,149.00	KIMBERLY-CLARK CORP	3,578,327.42	0.19	3,243.00	TESLA MOTORS INC	878,074.57	0.05
6,360.00	KLA CORPORATION	1,964,708.62	0.11	148,291.00	THERMO FISHER SCIENT SHS	76,774,064.50	4.15
190,111.00	KROGER CO	8,490,130.40	0.46	31,885.00	TRIMBLE	1,766,344.05	0.10
502.00	LAM RESEARCH CORP	187,548.61	0.01	47,036.00	TWITTER INC	2,104,892.81	0.11
76,425.00	LINCOLN NATIONAL CORP	3,425,531.31	0.19	61,519.00	TYSON FOODS INC -A-	4,140,200.76	0.22
24,000.00	LOWE'S CO INC	4,601,071.81	0.25	7,060.00	ULTA BEAUTY RG REGISTERED	2,891,238.10	0.16
14,736.00	MARKETAXESS HOLDING INC	3,346,718.36	0.18	93,507.00	UNDER ARMOUR INC -A-	634,738.48	0.03
19,900.00	MARTIN MARIETTA	6,542,735.67	0.35	8,163.00	UNION PACIFIC CORP	1,623,350.85	0.09
76,144.00	MCDONALD'S CORP	17,934,432.26	0.97	1.00	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	33.21	0.00
11,465.00	META PLATFORMS INC A	1,587,884.65	0.09	83,727.00	UNITEDHEALTH GROUP INC	43,163,868.81	2.33
1,277.00	METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	1,413,179.44	0.08	842,792.00	VERIZON COMMUNICATIONS INC	32,665,556.31	1.76
4,073.00	MICROCHIP TECHNOLOGY	253,738.77	0.01	38,652.00	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	11,423,773.88	0.62
8,497.00	MOLINA HEALTHCARE	2,860,869.17	0.15	208,610.00	VIATRIS INC - REGISTERED SHS	1,814,277.75	0.10
413,263.00	MONDELEZ INTERNATIONAL INC	23,129,903.83	1.25	6,474.00	WABTEC CORP	537,600.06	0.03
5,943.00	MONSTER BEVERAGE CORP	527,538.69	0.03	7,082.00	WALGREENS BOOTS	226,994.13	0.01
20,189.00	MORGAN STANLEY	1,628,268.15	0.09	32,390.00	WARNER BROS DISCOVERY INC	380,222.53	0.02
15,311.00	MOSAIC	755,352.04	0.04	65,943.00	WASTE MANAGEMENT	10,731,186.22	0.58
5,463.00	MSCI INC -A-	2,352,104.09	0.13	11,381.00	WATERS	3,131,241.70	0.17
59,348.00	NETAPP	3,746,923.70	0.20	71,705.00	WEC ENERGY GR	6,545,784.87	0.35
240,530.00	NEWMONT CORPORATION	10,319,477.26	0.56	290,108.00	WELLS FARGO AND CO	11,910,522.90	0.64
187,407.00	NEWS CORP -A-	2,890,542.31	0.16	8,846.00	WESTROCK	278,929.15	0.02
396,069.00	NEXTERA ENERGY	31,700,883.26	1.72	13,796.00	WEYERHAEUSER CO	402,198.50	0.02
277,722.00	NIKE INC	23,563,775.47	1.28	162,794.00	W.R.BERKLEY CORP	10,731,625.09	0.58
1,808.00	NORDSON	391,756.40	0.02	1,122.00	WW GRAINGER INC	560,272.73	0.03
14,661.00	NORFOLK SOUTHERN	3,137,527.33	0.17	8,096.00	WYNN RESORTS LTD	520,891.01	0.03
490,302.00	NVIDIA CORP	60,754,105.83	3.28	8,000.00	XYLEM INC	713,397.64	0.04
6,186.00	O REILLY AUTO	4,441,303.63	0.24	8,101.00	YUM BRANDS INC	879,355.22	0.05
37,756.00	ONEOK INC (NEW)	1,974,804.72	0.11	2,095.00	ZEBRA TECHNOLOGIES -A-	560,313.33	0.03
36,745.00	OTIS WORLDWIDE CORPORATION	2,393,029.14	0.13	6,789.00	ZIMMER BIOMET HLDGS SHS	724,534.22	0.04
1.00	PARAMOUNT GLOBAL	19.44	0.00	16,459.00	ZIONS BANCORPORATION NA	854,493.69	0.05
11,390.00	PARKER-HANNIFIN CORP	2,817,241.77	0.15		Finlande	701,560.32	0.04
9,690.00	PAYCHEX INC	1,109,901.39	0.06	16,032.00	SAMPO OYJ -A-	701,560.32	0.04
3,057.00	PAYCOM SOFTWARE INC	1,029,734.53	0.06		France	177,030,082.46	9.58
135,795.00	PEPSICO INC	22,630,420.76	1.22	136,886.00	AIR LIQUIDE SA	16,092,318.16	0.87
7,169.00	PHILLIPS 66	590,702.48	0.03	562,013.00	AXA SA	12,631,242.18	0.68
8,422.00	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC	1,284,555.95	0.07	350,000.00	ENGIE --- REGISTERED LOYALTY BONUS	4,144,700.00	0.22
10,996.00	PROCTER & GAMBLE CO	1,417,082.63	0.08	38,291.00	L'OREAL SA	12,645,602.75	0.68
83,965.00	PROGRESSIVE CORP	9,960,264.02	0.54				

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR	
85,363.00 LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	52,105,575.20	2.83
1,150,000.00 ORANGE	10,635,200.00	0.58
200,000.00 RENAULT SA	5,594,000.00	0.30
78,000.00 SAFRAN SA	7,332,780.00	0.40
624,916.00 SOCIETE GENERALE SA	12,757,660.14	0.69
851,331.00 TOTALENERGIESE	41,098,004.03	2.22
250,000.00 VIVENDI SA	1,993,000.00	0.11
FR-Curacao	21,492,543.77	1.16
586,495.00 SCHLUMBERGER LTD	21,492,543.77	1.16
Ile de Jersey	317,741.85	0.02
3,980.00 APTIV PLC	317,741.85	0.02
Irlande	27,434,979.76	1.48
51,899.00 ACCENTURE - SHS CLASS A	13,631,003.62	0.73
20,658.00 LINDE PLC	5,684,877.48	0.31
98,500.00 MEDTRONIC HLD	8,119,098.66	0.44
Libéria	105,654.98	0.01
2,731.00 ROYAL CARIBBEAN CRUISES	105,654.98	0.01
Panama	21.53	0.00
3.00 CARNIVAL CORP	21.53	0.00
Pays-Bas	53,501,033.02	2.90
207.00 AIRBUS SE	18,400.23	0.00
412,342.00 ING GROUP NV	3,652,525.44	0.20
14,351.00 KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	375,063.39	0.02
157,947.00 NXP SEMICONDUCTORS	23,782,740.74	1.29
409,218.00 STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	5,021,923.30	0.27
959,391.00 STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	11,777,483.92	0.64
88,800.00 WOLTERS KLUWER NV	8,872,896.00	0.48
Royaume-Uni	84,100,056.62	4.55
20,024.00 RELX PLC	501,801.44	0.03
3,148,088.00 SHELL PLC	80,701,235.88	4.36
64,065.00 UNILEVER	2,897,019.30	0.16
Suisse	7,351,999.44	0.40
702.00 ADECCO REG.SHS	19,956.25	0.00
53.00 BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	102,734.91	0.01
6,115.00 HELVETIA HLDG - REGISTERED SHS	589,176.00	0.03
898.00 LONZA GROUP (CHF)	452,911.64	0.02
33,951.00 NESTLE SA REG SHS	3,770,455.38	0.21
3,348.00 NOVARTIS AG REG SHS	262,263.47	0.01
55.00 ROCHE HOLDING LTD	18,450.27	0.00
1,129.00 SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	513,447.94	0.03
14,403.00 TE CONNECTIVITY LTD REG SHS	1,622,533.64	0.09
1.00 TEMENOS AG NAM.AKT	69.94	0.00
Total portefeuille-titres	1,817,658,171.60	98.38

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	263,673,943.94	98.84			
Actions	263,673,943.94	98.84			
Allemagne	11,159,884.00	4.18			
4,644.00 ALLIANZ SE REG SHS	751,399.20	0.28	62,090.00 KIMBERLY-CLARK CORP	7,132,760.27	2.67
12,574.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	96,140.80	0.04	4,332.00 LAM RESEARCH CORP	1,618,447.40	0.61
81,585.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	10,312,344.00	3.86	7,771.00 MARATHON PETROLEUM	787,927.76	0.30
Belgique	1,629,485.46	0.61	4,882.00 MARRIOTT INTERNATIONAL -A-	698,375.42	0.26
13,036.00 AGEAS NOM	488,067.84	0.18	6,109.00 MARSH MCLENNAN COS	930,957.60	0.35
23,457.00 KBC GROUPE SA	1,141,417.62	0.43	43,723.00 META PLATFORMS INC A	6,055,567.44	2.27
Espagne	21,433,522.05	8.03	60,221.00 MGM RESORTS INTL	1,826,946.48	0.68
4,235,598.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	10,154,846.21	3.81	10,602.00 MICROSOFT CORP	2,520,497.93	0.94
3,340,840.00 TELEFONICA SA	11,278,675.84	4.22	4,154.00 MSCI INC -A-	1,788,511.88	0.67
Etats-Unis d'Amérique	152,040,009.80	57.00	11,633.00 NEXTERA ENERGY	931,091.24	0.35
24,540.00 ALPHABET INC -A-	2,396,009.80	0.90	34,306.00 PAYCHEX INC	3,929,440.37	1.47
24,755.00 AMERICAN EXPRESS	3,409,071.66	1.28	2,445.00 PROCTER & GAMBLE CO	315,093.40	0.12
3,839.00 ANSYS INC	868,786.10	0.33	1,488.00 PUBLIC STORAGE INC	444,751.98	0.17
1,329.00 APA - REGISTERED SHS	46,382.39	0.02	6,374.00 REGENCY CENTERS	350,369.93	0.13
165,116.00 APPLE INC	23,293,044.66	8.74	2,521.00 SERVICENOW INC	971,729.51	0.36
95,500.00 APPLIED MATERIALS INC	7,986,847.34	2.99	9,166.00 SIGNATURE BANK	1,412,816.82	0.53
161,838.00 AT&T INC	2,534,165.18	0.95	1.00 SYNOPSIS	311.86	0.00
5,751.00 AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	1,327,840.24	0.50	12,882.00 TEXAS INSTRUMENTS INC	2,035,294.20	0.76
2,898.00 AVERY DENNISON CORP	481,299.04	0.18	5,355.00 THERMO FISHER SCIENT SHS	2,772,421.22	1.04
206,069.00 BANK OF AMERICA CORP	6,352,558.36	2.38	1,118.00 ULTA BEAUTY RG REGISTERED	457,847.62	0.17
3,531.00 BANK OF NY MELLON	138,839.50	0.05	3.00 UNDER ARMOUR INC -A-	20.36	0.00
5,624.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	1,532,915.31	0.57	2,259.00 VALERO ENERGY CORP	246,388.15	0.09
984.00 BLACKROCK INC	552,723.44	0.21	4,710.00 VERIZON COMMUNICATIONS INC	182,553.67	0.07
7,663.00 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	556,078.88	0.21	98,182.00 WASTE MANAGEMENT	16,056,487.75	6.03
18,850.00 BROADCOM INC - REGISTERED SHS	8,543,447.66	3.20	1,774.00 WW GRAINGER INC	885,850.11	0.33
3,652.00 BROADRIDGE FINANCIAL SOL -W/I	538,005.04	0.20	4,862.00 ZOETIS INC -A-	735,962.82	0.28
2.00 CARRIER GLOBAL CORP-WI	72.60	0.00	Finlande	6,146,236.96	2.30
963.00 CIGNA CORPORATION - REGISTERED SHS	272,754.16	0.10	121,667.00 KESKO CORP	2,329,314.72	0.87
132,750.00 CITIGROUP INC	5,646,600.83	2.12	87,224.00 SAMPO OYJ -A-	3,816,922.24	1.43
31,880.00 CME GROUP -A-	5,764,205.99	2.16	France	24,655,639.03	9.25
18,920.00 COCA-COLA CO	1,081,915.38	0.41	55,546.00 AIR LIQUIDE NOM. PRIME FIDELITE	6,529,987.76	2.46
24,606.00 COLGATE-PALMOLIVE CO	1,764,478.64	0.66	60,955.00 DANONE SA	2,960,584.35	1.11
4,945.00 CONSTELLATION BRANDS INC -A-	1,159,360.59	0.43	4,710.00 L OREAL-ACT REG PROV PRIM.FIDELITE 2013	1,555,477.50	0.58
10,191.00 COSTCO WHOLESALE CORP	4,912,880.69	1.84	300,000.00 ORANGE	2,774,400.00	1.04
131,235.00 CSX CORP	3,568,723.93	1.34	18,829.00 SANOFI	1,476,193.60	0.55
4,045.00 DOMINO PIZZA INC	1,280,823.76	0.48	223,759.00 SOCIETE GENERALE SA	4,568,039.99	1.71
141.00 DOW - REGISTERED SHS	6,322.80	0.00	99,243.00 TOTALENERGIESE	4,790,955.83	1.80
5.00 DXC TECHNOLOGY	124.94	0.00	Luxembourg	5.62	0.00
439.00 ELEVANCE HEALTH	203,553.68	0.08	1.00 SES GLOBAL CERT.GC FID.DEP.REC(1-A-SHS)	5.62	0.00
7,088.00 ENTERGY CORP	728,081.91	0.27	Pays-Bas	11,324,947.14	4.25
826.00 EXPEDIA GROUP INC	78,995.50	0.03	151,688.00 ING GROUP NV	1,343,652.30	0.50
27,906.00 FIFTH THIRD BANCORP	910,402.45	0.34	12,572.00 PROSUS NV	678,510.84	0.25
39,216.00 FIRSTENERGY CORP	1,481,133.06	0.56	581,424.00 ROYAL PHILIPS NV	9,302,784.00	3.50
17,867.00 GENERAL MILLS INC	1,397,224.39	0.52	Royaume-Uni	22,953,903.09	8.60
6,180.00 GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,848,669.42	0.69	99.00 RELX PLC	2,480.94	0.00
7,546.00 HENRY JACK AND ASSOCIATES INC	1,403,980.42	0.53	649,475.00 SHELL PLC	16,649,291.63	6.24
3,198.00 HONEYWELL INTERNATIONAL INC	545,062.07	0.20	139,366.00 UNILEVER	6,302,130.52	2.36
527.00 HUMANA INC	261,006.61	0.10	Suisse	12,330,310.79	4.62
9,014.00 INTUITIVE SURGICAL	1,724,681.43	0.65	4,760.00 ALCON - REGISTERED SHS	287,021.78	0.11
2,114.00 JOHNSON & JOHNSON	352,516.76	0.13	831.00 BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	1,610,805.85	0.60
			9.00 LONZA GROUP (CHF)	4,539.20	0.00
			18,759.00 NOVARTIS AG REG SHS	1,469,474.46	0.55
			12,193.00 SCHINDLER HOLDING SA	1,955,660.08	0.73

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR	
1,333.00 SWISSCOM SHS NOM	640,785.63	0.24
911.00 TE CONNECTIVITY LTD REG SHS	102,626.41	0.04
88,859.00 TEMENOS AG NAM.AKT	6,215,153.45	2.33
108.00 ZURICH INSURANCE GROUP NAMENSAKT	44,243.93	0.02
Total portefeuille-titres	263,673,943.94	98.84

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	2,755,464,892.03	98.80	17,691.00 BOEING CO	2,186,522.00	0.08
Actions	2,755,464,892.03	98.80	353,094.00 BOSTON SCIENTIF CORP	13,959,404.50	0.50
			296,498.00 BROADCOM INC - REGISTERED SHS	134,382,766.27	4.83
			15.00 BROADRIDGE FINANCIAL SOL -W/I	2,209.77	0.00
Allemagne	769,097.73	0.03	32,830.00 BROWN AND BROWN INC	2,026,803.86	0.07
283.00 ALLIANZ SE REG SHS	45,789.40	0.00	37,916.00 CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	6,325,332.39	0.23
50,494.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	386,077.12	0.02	69,364.00 CAMDEN PROPERTY SBI	8,457,642.83	0.30
113.00 SCOUT24	5,844.36	0.00	44,881.00 CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	4,222,611.92	0.15
3,250.00 SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	37,001.25	0.00	103,766.00 CARRIER GLOBAL CORP-WI	3,766,568.63	0.14
2,329.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	294,385.60	0.01	13,244.00 CATERPILLAR - REGISTERED	2,218,216.22	0.08
			11,864.00 CDW	1,890,198.66	0.07
Belgique	36,504.00	0.00	177,913.00 CELANESE RG REGISTERED SHS	16,406,533.37	0.59
975.00 AGEAS NOM	36,504.00	0.00	45,524.00 CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	4,472,704.54	0.16
			29,943.00 CHARLES SCHWAB CORP/THE	2,196,706.38	0.08
Bermudes	216,531.70	0.01	327.00 CHARTER COMM -A-	101,256.01	0.00
18,673.00 NORVERGIAN CRUISE LINE LTD	216,531.70	0.01	39,586.00 CHENIERE ENERGY INC	6,704,142.56	0.24
			40,641.00 CHEVRON CORP	5,960,182.18	0.21
Espagne	200,500,273.39	7.19	569,034.00 CITIGROUP INC	24,204,202.30	0.87
80,121,807.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	192,092,032.28	6.89	187,112.00 CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	6,562,719.67	0.24
712,261.00 REPSOL SA	8,408,241.11	0.30	78,532.00 CME GROUP -A-	14,199,329.52	0.51
			47,803.00 CMS ENERGY CORP	2,841,878.96	0.10
Etats-Unis d'Amérique	1,962,129,890.41	70.35	45,885.00 COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS -A-	2,690,383.71	0.10
117,789.00 ABBOTT LABORATORIES	11,634,015.86	0.42	74,613.00 COMERICA INC	5,415,183.28	0.19
252,754.00 ABBVIE INC	34,626,769.09	1.24	112,734.00 CONAGRA BRANDS INC	3,754,923.11	0.13
3,517.00 ABIOMED INC	881,933.57	0.03	10,179.00 CONOCOPHILLIPS CO	1,063,358.20	0.04
298,270.00 ACTIVISION BLIZZARD	22,633,993.57	0.81	44,941.00 CONSOLIDATED EDISON INC	3,934,201.15	0.14
129,705.00 ADOBE INC	36,436,294.60	1.31	68,143.00 CONSTELLATION BRANDS INC -A-	15,976,199.91	0.57
4,324.00 ADVANCED MICRO DEVICES INC	279,659.72	0.01	23,221.00 CONSTELLATION ENERGY	1,971,882.81	0.07
17,489.00 AFLAC INC	1,003,298.93	0.04	14,624.00 COOPER COMPANIES INC	3,939,441.23	0.14
123,175.00 AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	29,261,999.44	1.05	30,680.00 COPART INC	3,332,161.49	0.12
1,129.00 AKAMAI TECHNOLOGIES	92,564.98	0.00	90,578.00 CORTEVA - REGISTERED SHS	5,284,063.39	0.19
20,868.00 ALEXANDRIA REAL ESTATE	2,986,255.21	0.11	46,076.00 COSTCO WHOLESALE CORP	22,212,333.51	0.80
16,600.00 ALLIANT ENERGY CORP	897,906.40	0.03	17,952.00 CROWN CASTLE INC	2,648,866.02	0.09
555,428.00 ALPHABET INC -A-	54,230,274.28	1.95	171,694.00 CSX CORP	4,668,941.11	0.17
24,635.00 AMERICIAN WATER WORKS CO INC	3,273,099.17	0.12	11,981.00 CVS HEALTH	1,166,363.47	0.04
8,496.00 AMEREN CORPORATION	698,568.67	0.03	16,956.00 DARDEN RESTAURANTS INC	2,186,374.64	0.08
1,643.00 AMERICAN AIRLINES GROUP INC-REGS	20,192.64	0.00	309,297.00 DELTA AIR LINES	8,859,157.68	0.32
238,299.00 AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	21,028,886.39	0.75	1,719.00 DISH NETWORK -A-	24,267.62	0.00
57,536.00 AMERICAN INTL	2,788,556.40	0.10	169,785.00 DOMINION RESOURCES - REGSITERED	11,977,585.21	0.43
1,176.00 AMERIPRISE FINANCIAL INC	302,448.02	0.01	2,304.00 DOVER CORP	274,179.88	0.01
10,248.00 AMERISOURCEBERGEN CORP	1,415,670.74	0.05	4,727.00 DR HORTON	324,976.73	0.01
36,227.00 AMPHENOL -A-	2,476,149.56	0.09	65,267.00 EBAY INC	2,452,384.29	0.09
2,675.00 ANSYS INC	605,366.71	0.02	317,824.00 EDISON INTERNATIONAL	18,356,027.07	0.66
496.00 APA - REGISTERED SHS	17,310.51	0.00	31,438.00 EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,651,683.70	0.10
302,063.00 APPLE INC	42,612,266.22	1.53	13,577.00 ELECTRONIC ARTS - REGISTERED	1,603,628.51	0.06
94,480.00 APPLIED MATERIALS INC	7,901,542.80	0.28	125,973.00 ELI LILLY & CO	41,579,512.63	1.49
100,604.00 ARISTA NETWORKS INC	11,593,105.25	0.42	83,924.00 ENPHASE ENERGY	23,770,114.10	0.85
27,606.00 ARTHUR J.GALLAGHER AN CO	4,824,885.74	0.17	372.00 EPAM SYSTEMS	137,533.49	0.00
98,074.00 AT&T INC	1,535,706.79	0.06	286,065.00 EQT	11,899,299.49	0.43
1,724.00 AUTODESK INC	328,732.91	0.01	12,346.00 EQUINIX INC	7,168,783.38	0.26
166,493.00 AVALONBAY COMMUN	31,303,369.23	1.12	414,434.00 EVERSOURCE ENERGY	32,980,426.32	1.18
2,792.00 AVERY DENNISON CORP	463,694.58	0.02	245,230.00 EXPEDIA GROUP INC	23,452,864.49	0.84
15,000.00 BANK OF AMERICA CORP	462,410.04	0.02	29,332.00 EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	2,644,116.69	0.09
316.00 BANK OF NY MELLON	12,425.17	0.00	70,453.00 EXXON MOBIL CORP	6,279,029.68	0.23
42,591.00 BAXTER INTERNATIONAL INC	2,341,602.88	0.08	89,023.00 FEDEX CORP	13,491,803.00	0.48
35,648.00 BECTON DICKINSON	8,108,450.81	0.29	61,025.00 FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES INC	4,707,455.98	0.17
136,834.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	37,296,396.35	1.34	77,257.00 FIFTH THIRD BANCORP	2,520,424.36	0.09
16,266.00 BLACKROCK INC	9,136,788.12	0.33			

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets		
	EUR			EUR			
165,625.00	FIRSTENERGY CORP	6,255,422.86	0.22	1,033,848.00	NEWMONT CORPORATION	44,355,261.00	1.59
145,999.00	FOX CORP -A-	4,572,295.53	0.16	180,724.00	NEXTERA ENERGY	14,464,930.17	0.52
28,918.00	FOX CORP -B-	841,283.11	0.03	506,131.00	NIKE INC	42,943,509.13	1.54
500,679.00	FREEMPORT MCMORAN COPPER AND GOLD INC	13,967,801.84	0.50	3,378.00	NORFOLK SOUTHERN	722,908.90	0.03
18,847.00	GENERAL ELECTRI	1,191,055.75	0.04	6.00	NORTHERN TRUST CORP	524.02	0.00
28,032.00	GENERAL MILLS INC	2,192,141.60	0.08	340.00	NVR INC	1,383,766.86	0.05
89,441.00	GENERAL MOTORS CO	2,929,782.77	0.11	2,656.00	O REILLY AUTO	1,906,903.08	0.07
156,774.00	GILEAD SCIENCES INC	9,872,289.14	0.35	2,262.00	ORACLE CORP	141,009.89	0.01
34,498.00	GLOBE LIFE INC	3,510,897.36	0.13	341,799.00	OTIS WORLDWIDE CORPORATION	22,259,762.36	0.80
46,017.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC	13,765,407.90	0.49	263,637.00	PACKAGING CORP OF AMERICA	30,218,750.30	1.08
118,916.00	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,782,171.92	0.10	4,683.00	PARKER-HANNIFIN CORP	1,158,309.32	0.04
17,042.00	HERSHEY	3,835,298.06	0.14	5,841.00	PAYCOM SOFTWARE INC	1,967,510.43	0.07
22,996.00	HOLOGIC INC	1,514,522.45	0.05	7,279.00	PAYPAL HOLDINGS	639,517.72	0.02
27,768.00	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	4,732,734.10	0.17	48,361.00	PENN ENTERTAINMENT INC	1,358,047.37	0.05
11,252.00	HOWMET AEROSPC - REGISTERED SHS	355,253.77	0.01	38,202.00	PEPSICO INC	6,366,415.07	0.23
190,496.00	HP INC	4,845,771.78	0.17	13,410.00	PERKINELMER	1,647,144.69	0.06
30,480.00	HUMANA INC	15,095,790.54	0.54	338,329.00	PFIZER INC	15,112,822.99	0.54
161.00	HUNTINGTON BANCSHARES INC	2,166.06	0.00	42,395.00	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC	6,466,249.07	0.23
13,826.00	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIESINC	3,126,074.62	0.11	10,108.00	PROCTER & GAMBLE CO	1,302,643.80	0.05
20,159.00	IDEX CORP	4,112,464.81	0.15	202,316.00	PROLOGIS	20,982,295.31	0.75
15,499.00	ILLUMINA INC	3,018,480.28	0.11	8,069.00	PTC INC	861,549.94	0.03
22,179.00	INCYTE CORP	1,508,710.83	0.05	3,500.00	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	200,893.18	0.01
17,312.00	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,596,630.63	0.06	8,040.00	PUBLIC STORAGE INC	2,403,095.39	0.09
678.00	INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	17,717.35	0.00	10,275.00	QORVO INC	832,887.00	0.03
52,776.00	INTL FLAVORS & FRAG	4,893,221.13	0.18	87,437.00	QUALCOMM INC	10,083,838.37	0.36
15,781.00	INTUIT	6,239,265.98	0.22	65,952.00	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORPORATION	5,510,979.15	0.20
66,595.00	INTUITIVE SURGICAL	12,741,863.73	0.46	56,092.00	REGENCY CENTERS	3,083,299.34	0.11
87,453.00	INVITATION HOMS REGISTERED	3,014,635.65	0.11	10,302.00	REGENERON PHARMACEUTICALS INC	7,244,157.34	0.26
140,050.00	JOHNSON & JOHNSON	23,353,818.20	0.84	2,640.00	REGIONS FINANCIAL CORP	54,085.44	0.00
9,860.00	KIMBERLY-CLARK CORP	1,132,694.74	0.04	5,860.00	ROSS STORES INC	504,080.23	0.02
11,796.00	KINDER MORGAN INC	200,362.82	0.01	161,812.00	SALESFORCE INC	23,758,524.04	0.85
233,109.00	KROGER CO	10,410,369.77	0.37	56,437.00	SERVICENOW INC	21,753,866.76	0.78
35,483.00	LAM RESEARCH CORP	13,256,548.77	0.48	8,391.00	SHERWIN WILLIAMS CO	1,753,745.98	0.06
8,696.00	LAS VEGAS SANDS CORP	333,051.52	0.01	164,386.00	SKYWORKS SOLUTIONS INC	14,308,369.54	0.51
38,114.00	LINCOLN NATIONAL CORP	1,708,350.68	0.06	4,717.00	SNAP ON INC	969,497.22	0.03
16,671.00	LOWE'S CO INC	3,196,019.51	0.11	283.00	SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC	66,863.86	0.00
82,537.00	MARATHON OIL CORP	1,902,399.29	0.07	129,971.00	SOUTHERN CO	9,021,617.92	0.32
2,025.00	MARKEL CORP	2,241,152.96	0.08	132,330.00	SOUTHWEST AIRLINES CO - REGISTERED	4,165,831.88	0.15
49,369.00	MARKETAXESS HOLDING INC	11,212,278.68	0.40	202,326.00	STATE STREET CORP	12,559,020.12	0.45
13,713.00	MARRIOTT INTERNATIONAL -A-	1,961,659.59	0.07	2,727.00	SYNOPSIS	850,432.06	0.03
7,643.00	MCCORMICK & CO INC NON VOTING	556,031.86	0.02	52,760.00	SYSCO CORP	3,808,155.57	0.14
3,694.00	MCDONALD'S CORP	870,059.27	0.03	12,090.00	TAKE TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC	1,345,184.50	0.05
3,220.00	MERCK & CO INC	283,066.81	0.01	1.00	TELEFLEX INC	205.64	0.00
29,465.00	META PLATFORMS INC A	4,080,856.63	0.15	330,343.00	TEXAS INSTRUMENTS INC	52,192,609.14	1.88
9,275.00	METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	10,264,087.17	0.37	84,461.00	THE HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	5,340,187.15	0.19
151,260.00	MGM RESORTS INTL	4,588,829.89	0.16	159,285.00	THERMO FISHER SCIENT SHS	82,465,941.05	2.97
5,607.00	MICROCHIP TECHNOLOGY	349,303.54	0.01	3,311.00	TRACTOR SUPPLY CO	628,233.23	0.02
53,032.00	MICROSOFT CORP	12,607,719.90	0.45	10,053.00	TRIMBLE	556,909.42	0.02
7,923.00	MID-AMER APARTMENT COMMUNITIES INC	1,254,141.39	0.04	49,948.00	TWITTER INC	2,235,206.78	0.08
3,547.00	MOLINA HEALTHCARE	1,194,245.37	0.04	81,621.00	TYSON FOODS INC -A-	5,493,056.22	0.20
595,055.00	MORGAN STANLEY	47,991,931.35	1.72	127,763.00	UDR	5,439,692.47	0.20
26,249.00	MOSAIC	1,294,966.74	0.05	8,820.00	ULTA BEAUTY RG REGISTERED	3,612,000.00	0.13
13,067.00	MSCI INC -A-	5,626,019.43	0.20	41.00	UNDER ARMOUR INC -A-	278.31	0.00
1.00	M&T BANK CORPORATION	179.98	0.00	4,061.00	UNION PACIFIC CORP	807,598.65	0.03
53,522.00	NASDAQ INC	3,096,643.66	0.11	9,400.00	UNITED RENTALS INC	2,591,872.61	0.09
191,692.00	NETAPP	12,102,434.75	0.43	94,376.00	UNITEDHEALTH GROUP INC	48,653,759.04	1.74
1,187.00	NETFLIX INC	285,272.58	0.01	335,467.00	US BANCORP	13,807,001.93	0.50

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets		
	EUR			EUR			
282,308.00	VALERO ENERGY CORP	30,791,210.94	1.10	42,789.00	UNILEVER	1,934,918.58	0.07
249,851.00	VENTAS INC	10,245,000.43	0.37		Suisse	152,833,507.44	5.48
3,541.00	VERISIGN INC	627,848.42	0.02	2.00	BALOISE HOLDING REG.SHS	262.81	0.00
677,666.00	VERIZON COMMUNICATIONS INC	26,265,480.55	0.94	332,594.00	CHUBB - NAMEN AKT	61,748,784.48	2.21
42,410.00	VULCAN MATERIALS CO	6,827,419.08	0.24	421,868.00	NESTLE SA REG SHS	46,850,887.20	1.68
20,568.00	WABTEC CORP	1,707,963.86	0.06	347,802.00	NOVARTIS AG REG SHS	27,244,850.72	0.98
258,186.00	WALMART INC	34,182,334.71	1.23	1,741.00	ROCHE HOLDING LTD	584,034.90	0.02
119,322.00	WARNER BROS DISCOVERY INC	1,400,707.40	0.05	258.00	TEMENOS AG NAM.AKT	18,045.55	0.00
66,906.00	WASTE MANAGEMENT	10,941,673.31	0.39	40,000.00	ZURICH INSURANCE GROUP NAMENSAKT	16,386,641.78	0.59
6,812.00	WATERS	1,874,177.88	0.07		Total portefeuille-titres	2,755,464,892.03	98.80
25,423.00	WEC ENERGY GR	2,320,807.32	0.08				
25,783.00	WELLS FARGO AND CO	1,058,533.41	0.04				
4,836.00	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	1,214,763.31	0.04				
74,521.00	WESTROCK	2,349,771.54	0.08				
4,590.00	WW GRAINGER INC	2,292,024.80	0.08				
5,728.00	ZEBRA TECHNOLOGIES -A-	1,531,968.85	0.05				
120,372.00	ZIONS BANCORPORATION NA	6,249,293.03	0.22				
	France	251,475,729.07	9.02				
10,903.00	ACCOR SA	235,613.83	0.01				
35,417.00	AIR LIQUIDE NOM. PRIME FIDELITE	4,163,622.52	0.15				
3,895.00	AIR LIQUIDE SA	457,896.20	0.02				
694,444.00	AXA SA	15,607,628.90	0.56				
400,000.00	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	9,262,000.00	0.33				
696,512.00	DANONE SA	33,829,587.84	1.21				
817,041.00	ENGIE --- REGISTERED LOYALTY BONUS	9,675,399.52	0.35				
75,000.00	ESSILORLUXOTTICA SA	10,526,250.00	0.38				
43,864.00	L OREAL-ACT REG PROV PRIM.FIDELITE 2013	14,486,086.00	0.52				
3,613,352.00	ORANGE	33,416,279.30	1.20				
80,000.00	SAFRAN SA	7,520,800.00	0.27				
1,349,080.00	SOCIETE GENERALE SA	27,541,468.20	0.99				
1,664,327.00	TOTALENERGIESSE	80,345,385.93	2.87				
552,899.00	VIVENDI SA	4,407,710.83	0.16				
	FR-Curacao	712,759.66	0.03				
19,450.00	SCHLUMBERGER LTD	712,759.66	0.03				
	Irlande	112,054,332.46	4.02				
137,535.00	ACCENTURE - SHS CLASS A	36,122,855.61	1.29				
8,076.00	AON - REGISTERED SHS (USD)	2,208,256.13	0.08				
21,582.00	EATON CORPORATION PUBLIC LIMITED COMPANY	2,937,963.07	0.11				
616,135.00	JOHNSON CONTROLS INTL	30,956,121.78	1.11				
124,680.00	LINDE PLC	34,310,704.03	1.23				
66,949.00	MEDTRONIC HLD	5,518,431.84	0.20				
	Libéria	33,657.94	0.00				
870.00	ROYAL CARIBBEAN CRUISES	33,657.94	0.00				
	Luxembourg	122,961.17	0.00				
21,887.00	SES GLOBAL CERT.GC FID.DEP.REC(1-A-SHS)	122,961.17	0.00				
	Pays-Bas	21,604,251.34	0.77				
7,010.00	AIRBUS SE	623,118.90	0.02				
1,475,145.00	ING GROUP NV	13,066,834.41	0.47				
36,898.00	NXP SEMICONDUCTORS	5,555,886.27	0.20				
23,603.00	WOLTERS KLUWER NV	2,358,411.76	0.08				
	Royaume-Uni	52,975,395.72	1.90				
4,321.00	NIELSEN HOLDINGS PLC	122,266.24	0.00				
1,986,277.00	SHELL PLC	50,918,210.90	1.83				

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	197,279,962.89	98.26			
Actions	197,279,962.89	98.26			
Allemagne	2,112,888.80	1.05			
828.00 ALLIANZ SE REG SHS	133,970.40	0.07	5,019.00 KEYSIGHT TECHNOLOGIES	806,195.93	0.40
15,656.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	1,978,918.40	0.98	7,346.00 LOWE'S CO INC	1,408,311.40	0.70
Belgique	84.80	0.00	8,107.00 MARKETAXESS HOLDING INC	1,841,194.74	0.92
1.00 COFINIMMO SA	84.80	0.00	79,049.00 META PLATFORMS INC A	10,948,163.45	5.45
Espagne	17,039,624.17	8.49	38,380.00 MICROSOFT CORP	9,124,383.20	4.54
1,852,392.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	4,441,109.82	2.21	8,849.00 MOSAIC	436,556.09	0.22
31,248.00 INDITEX SHARE FROM SPLIT	664,957.44	0.33	2.00 NETFLIX INC	480.66	0.00
541,431.00 REPSOL SA	6,391,592.96	3.19	23,445.00 NIKE INC	1,989,229.21	0.99
1,641,577.00 TELEFONICA SA	5,541,963.95	2.76	2.00 PAYPAL HOLDINGS	175.72	0.00
Etats-Unis d'Amérique	135,587,971.67	67.53	4,623.00 PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC	705,117.81	0.35
4,863.00 ABBOTT LABORATORIES	480,318.36	0.24	6,857.00 PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	393,578.43	0.20
3,512.00 ABIOMED INC	880,679.75	0.44	1,515.00 PUBLIC STORAGE INC	452,822.08	0.23
2,915.00 ADOBE INC	818,872.05	0.41	1.00 QORVO INC	81.06	0.00
154,363.00 ALPHABET INC -A-	15,071,526.51	7.51	4,211.00 SOUTHERN CO	292,296.23	0.15
181,513.00 ALPHABET INC -C-	17,815,010.41	8.87	5,459.00 TESLA MOTORS INC	1,478,078.65	0.74
33,185.00 AMERICAN EXPRESS	4,569,987.60	2.28	5,269.00 TEXAS INSTRUMENTS INC	832,476.72	0.41
9,240.00 AMERISOURCEBERGEN CORP	1,276,424.44	0.64	4,920.00 THERMO FISHER SCIENT SHS	2,547,210.53	1.27
58,883.00 APPLE INC	8,306,671.36	4.14	60,848.00 TWITTER INC	2,722,989.15	1.36
5,259.00 ARISTA NETWORKS INC	606,021.04	0.30	8.00 UNDER ARMOUR INC -A-	54.31	0.00
316,930.00 AT&T INC	4,962,697.09	2.47	3,610.00 VERIZON COMMUNICATIONS INC	139,919.05	0.07
6,030.00 AUTODESK INC	1,149,802.48	0.57	France	6,754,472.73	3.36
1,785.00 AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	412,136.12	0.21	15,963.00 AIR LIQUIDE NOM. PRIME FIDELITE	1,876,610.28	0.93
303,015.00 BANK OF AMERICA CORP	9,341,145.31	4.65	7,226.00 L'OREAL SA	2,386,386.50	1.19
4,614.00 BECTON DICKINSON	1,049,494.84	0.52	11,389.00 SANOFI	892,897.60	0.44
37,673.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	10,268,406.53	5.11	33,114.00 TOTALENERGIESSE	1,598,578.35	0.80
91.00 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	6,603.57	0.00	Irlande	6,741,540.90	3.36
5,137.00 BROADRIDGE FINANCIAL SOL -WI	756,772.15	0.38	1,625.00 ACCENTURE - SHS CLASS A	426,797.84	0.21
4,111.00 CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	386,781.88	0.19	764.00 EATON CORPORATION PUBLIC LIMITED COMPANY	104,003.51	0.05
975.00 CINTAS	386,347.42	0.19	75,348.00 MEDTRONIC HLD	6,210,739.55	3.10
31,187.00 CITIGROUP INC	1,326,557.74	0.66	Luxembourg	5.62	0.00
7,256.00 CME GROUP -A-	1,311,953.53	0.65	1.00 SES GLOBAL CERT.GC FID.DEP.REC(1-A-SHS)	5.62	0.00
49,235.00 COCA-COLA CO	2,815,438.88	1.40	Pays-Bas	527,041.86	0.26
11,491.00 CONSOLIDATED EDISON INC	1,005,939.02	0.50	415.00 HEINEKEN NV	37,291.90	0.02
1,395.00 CONSTELLATION BRANDS INC -A-	327,059.26	0.16	55,289.00 ING GROUP NV	489,749.96	0.24
78.00 COSTCO WHOLESALE CORP	37,602.27	0.02	Royaume-Uni	13,646,177.01	6.80
798.00 CSX CORP	21,700.32	0.01	532,326.00 SHELL PLC	13,646,177.01	6.80
5,086.00 DOMINION RESOURCES - REGSITERED	358,794.94	0.18	Suisse	14,870,155.33	7.41
2.00 DXC TECHNOLOGY	49.98	0.00	15,013.00 HELVETIA HLDG - REGISTERED SHS	1,446,492.12	0.72
2,157.00 ELEVANCE HEALTH	1,000,148.71	0.50	101,679.00 NOVARTIS AG REG SHS	7,964,960.45	3.97
2,195.00 ELI LILLY & CO	724,496.76	0.36	6,908.00 ROCHE HOLDING LTD	2,317,353.87	1.15
51.00 EXPEDIA GROUP INC	4,877.45	0.00	234.00 SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	106,418.79	0.05
1,335.00 FORTIVE CORP	79,447.25	0.04	13,965.00 TEMENOS AG NAM.AKT	976,767.89	0.49
1,799.00 GARTNER INC	508,105.25	0.25	5,024.00 ZURICH INSURANCE GROUP NAMENSAKT	2,058,162.21	1.03
11,051.00 HERSHEY	2,487,024.93	1.24	Total portefeuille-titres	197,279,962.89	98.26
1.00 HOLOGIC INC	65.86	0.00			
12,344.00 ILLUMINA INC	2,404,033.85	1.20			
204,527.00 INTEL CORP	5,380,146.78	2.68			
1,924.00 INTUIT	760,683.59	0.38			
1,410.00 INTUITIVE SURGICAL	269,780.43	0.13			
594.00 JOHNSON & JOHNSON	99,051.54	0.05			

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	139,006,097.73	98.53	1,239.00 UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	41,141.91	0.03
Actions	139,006,097.73	98.53	31.00 VALERO ENERGY CORP	3,381.16	0.00
			17,960.00 WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	4,511,403.87	3.20
			176.00 ZIONS BANCORPORATION NA	9,137.30	0.01
Allemagne	11,726,487.82	8.31	Finlande	170,182.64	0.12
382,591.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	2,925,290.79	2.07	3,889.00 SAMPO OYJ -A-	170,182.64	0.12
59,677.00 RWE AG	2,255,193.83	1.60	France	28,000,544.46	19.85
51,788.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	6,546,003.20	4.64	220,207.00 AXA SA	4,949,152.33	3.51
Autriche	223,656.30	0.16	100,000.00 DANONE SA	4,857,000.00	3.44
34,526.00 AMS-OSRAM AG	223,656.30	0.16	7,140.00 L OREAL-ACT REG PROV PRIM.FIDELITE 2013	2,357,985.00	1.67
Etats-Unis d'Amérique	85,332,567.14	60.48	300,000.00 ORANGE	2,774,400.00	1.97
8,436.00 ABBOTT LABORATORIES	833,223.46	0.59	44,344.00 SANOFI	3,476,569.60	2.46
5,599.00 ABBVIE INC	767,051.28	0.54	162,293.00 SOCIETE GENERALE SA	3,313,211.60	2.35
3,120.00 ABIOMED INC	782,380.65	0.55	129,927.00 TOTALENERGIESSE	6,272,225.93	4.45
6,951.00 ADOBE INC	1,952,651.66	1.38	Irlande	759,831.47	0.54
13,922.00 ALPHABET INC -A-	1,359,301.08	0.96	2,893.00 ACCENTURE - SHS CLASS A	759,831.47	0.54
112,260.00 ALPHABET INC -C-	11,018,015.62	7.81	Panama	43.06	0.00
9,254.00 AMERICAN AIRLINES GROUP INC-REGS	113,732.62	0.08	6.00 CARNIVAL CORP	43.06	0.00
2,031.00 AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	179,227.22	0.13	Pays-Bas	63,467.46	0.04
8,982.00 AMERICAN EXPRESS	1,236,933.21	0.88	714.00 AIRBUS SE	63,467.46	0.04
2,050.00 AMGEN INC	471,668.45	0.33	Royaume-Uni	4,975,979.59	3.53
85,146.00 APPLE INC	12,011,613.54	8.52	164,195.00 SHELL PLC	4,209,138.83	2.99
20,496.00 AT&T INC	320,939.76	0.23	16,958.00 UNILEVER	766,840.76	0.54
260,413.00 BANK OF AMERICA CORP	8,027,839.13	5.69	Suisse	7,753,337.79	5.50
31,581.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	8,607,930.00	6.10	25,915.00 ALCON - REGISTERED SHS	1,562,640.63	1.11
3,348.00 BOSTON SCIENTIF CORP	132,361.60	0.09	10,280.00 HOLCIM LTD	436,915.99	0.31
3,328.00 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	241,502.09	0.17	73,023.00 NOVARTIS AG REG SHS	5,720,210.73	4.06
2,600.00 BROADCOM INC - REGISTERED SHS	1,178,406.57	0.84	298.00 TE CONNECTIVITY LTD REG SHS	33,570.44	0.02
8,835.00 CHARLES SCHWAB CORP/THE	648,161.54	0.46	Total portefeuille-titres	139,006,097.73	98.53
3,205.00 CIGNA CORPORATION - REGISTERED SHS	907,764.35	0.64			
45,523.00 CITIGROUP INC	1,936,348.09	1.37			
1,777.00 COSTCO WHOLESALE CORP	856,656.75	0.61			
119,644.00 CSX CORP	3,253,525.40	2.31			
385.00 DOW - REGISTERED SHS	17,264.38	0.01			
4,602.00 DUKE ENERGY CORP	436,970.39	0.31			
5,962.00 EBAY INC	224,020.03	0.16			
1,966.00 ELI LILLY & CO	648,911.45	0.46			
84,003.00 GENERAL MOTORS CO	2,751,652.40	1.95			
398.00 HOLOGIC INC	26,212.38	0.02			
395.00 HOME DEPOT INC	111,260.45	0.08			
1,180.00 HONEYWELL INTERNATIONAL INC	201,117.34	0.14			
2,035.00 INCYTE CORP	138,429.44	0.10			
12,736.00 INTUITIVE SURGICAL	2,436,825.23	1.73			
3,840.00 J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	613,130.00	0.43			
1,946.00 MARKETAXESS HOLDING INC	441,959.41	0.31			
59,766.00 META PLATFORMS INC A	8,277,497.96	5.87			
10,653.00 MICROSOFT CORP	2,532,622.57	1.80			
7,460.00 MORGAN STANLEY	601,658.35	0.43			
3,313.00 MSCI INC -A-	1,426,417.87	1.01			
5.00 NIKE INC	424.23	0.00			
1,681.00 O REILLY AUTO	1,206,891.59	0.86			
1,095.00 PFIZER INC	48,912.57	0.03			
642.00 PROCTER & GAMBLE CO	82,736.18	0.06			
339.00 PROLOGIS	35,157.86	0.02			
3,226.00 THERMO FISHER SCIENT SHS	1,670,183.17	1.18			
2.00 UNDER ARMOUR INC -A-	13.58	0.00			

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	173,179,321.02	98.71	France	44,801,402.21	25.54
Actions	173,179,321.02	98.71	3,931.00 ACCOR SA	84,948.91	0.05
Allemagne	6,913,694.42	3.94	217,561.00 CARREFOUR SA	3,092,629.62	1.76
20,941.00 ALLIANZ SE REG SHS	3,388,253.80	1.93	238,225.00 CIE DE SAINT-GOBAIN	8,826,236.25	5.03
461,083.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	3,525,440.62	2.01	114,297.00 ENGIE --- REGISTERED LOYALTY BONUS	1,353,505.07	0.77
Etats-Unis d'Amérique	92,780,431.04	52.88	45,519.00 L OREAL-ACT REG PROV PRIM.FIDELITE 2013	15,032,649.75	8.57
3.00 ADOBE INC	842.75	0.00	102.00 LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	62,260.80	0.04
1.00 AKAMAI TECHNOLOGIES	81.99	0.00	122,644.00 ORANGE	1,134,211.71	0.65
84,201.00 ALPHABET INC -A-	8,221,125.56	4.68	85,058.00 SANOFI	6,668,547.20	3.80
138,241.00 ALPHABET INC -C-	13,567,980.55	7.72	177,036.00 TOTALENERGIESE	8,546,412.90	4.87
33,614.00 AMERICAN EXPRESS	4,629,066.24	2.64	Irlande	4,215,996.53	2.40
41.00 AMPHENOL -A-	2,802.39	0.00	51,148.00 MEDTRONIC HLD	4,215,996.53	2.40
45,339.00 APPLE INC	6,396,008.57	3.64	Panama	28.70	0.00
503.00 ARTHUR J.GALLAGHER AN CO	87,912.68	0.05	4.00 CARNIVAL CORP	28.70	0.00
308,058.00 BANK OF AMERICA CORP	9,496,607.56	5.40	Pays-Bas	682,675.20	0.39
21,563.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	5,877,356.46	3.35	7,680.00 AIRBUS SE	682,675.20	0.39
530.00 BROADCOM INC - REGISTERED SHS	240,213.65	0.14	Royaume-Uni	13,278,224.57	7.57
16,362.00 CATERPILLAR - REGISTERED	2,740,445.02	1.56	493,931.00 SHELL PLC	12,661,921.19	7.22
26,778.00 CBOE HOLDINGS INC	3,208,221.16	1.83	13,629.00 UNILEVER	616,303.38	0.35
14,261.00 CHARLES SCHWAB CORP/THE	1,046,228.83	0.60	Suisse	10,506,868.35	5.99
1.00 CHIPOTLE MEXICAN GRILL -A-	1,533.98	0.00	201.00 BALOISE HOLDING REG.SHS	26,412.26	0.02
481.00 CINCINNATI FINANCIAL CORP	43,978.12	0.03	54,913.00 NOVARTIS AG REG SHS	4,301,575.29	2.45
73,879.00 CITIGROUP INC	3,142,487.55	1.79	9,111.00 ROCHE HOLDING LTD	3,056,371.03	1.74
24.00 COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS -A-	1,407.20	0.00	44,643.00 TEMENOS AG NAM.AKT	3,122,509.77	1.78
13,519.00 CONSTELLATION BRANDS INC -A-	3,169,544.14	1.81	Total portefeuille-titres	173,179,321.02	98.71
5,165.00 COSTCO WHOLESALE CORP	2,489,944.93	1.42			
715.00 CSX CORP	19,443.27	0.01			
1,303.00 DXC TECHNOLOGY	32,560.04	0.02			
1.00 EDWARDS LIFESCIENCES CORP	84.35	0.00			
2,205.00 GOLDMAN SACHS GROUP INC	659,598.07	0.38			
5.00 HERSHEY	1,125.25	0.00			
13,999.00 HOLOGIC INC	921,977.73	0.53			
4,236.00 INTUITIVE SURGICAL	810,489.30	0.46			
4,878.00 IPG PHOTONICS CORP	420,006.43	0.24			
20,167.00 J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	3,220,050.16	1.84			
1,970.00 KEYSIGHT TECHNOLOGIES	316,438.73	0.18			
9,281.00 MARATHON PETROLEUM	941,031.73	0.54			
32,367.00 META PLATFORMS INC A	4,482,779.11	2.56			
21,085.00 MICROSOFT CORP	5,012,705.05	2.86			
404.00 MOHAWK INDUSTRIES INC	37,606.04	0.02			
61,788.00 MORGAN STANLEY	4,983,279.62	2.84			
3,893.00 OTIS WORLDWIDE CORPORATION	253,532.79	0.14			
1,527.00 PROLOGIS	158,365.95	0.09			
1,700.00 PUBLIC STORAGE INC	508,117.18	0.29			
745.00 QUALCOMM INC	85,918.54	0.05			
860.00 SERVICENOW INC	331,490.43	0.19			
2.00 SOUTHERN CO	138.83	0.00			
1,446.00 SYNOPSIS	450,944.17	0.26			
1,261.00 THERMO FISHER SCIENT SHS	652,852.13	0.37			
27,372.00 TWITTER INC	1,224,915.51	0.70			
7.00 UNDER ARMOUR INC -A-	47.52	0.00			
7,435.00 UNION PACIFIC CORP	1,478,575.72	0.84			
5,271.00 WABTEC CORP	437,703.11	0.25			
3,645.00 ZEBRA TECHNOLOGIES -A-	974,864.95	0.56			

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	595,652,515.21	99.48			
Actions	595,652,515.21	99.48			
Allemagne	29,184,512.67	4.87			
83,010.00 ALLIANZ SE REG SHS	13,431,018.00	2.24	894.00 COSTCO WHOLESALE CORP	430,979.82	0.07
72,349.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	553,180.45	0.09	78,465.00 CROWN CASTLE INC	11,577,722.40	1.93
396,711.00 RWE AG	14,991,708.69	2.51	490,385.00 CSX CORP	13,335,228.30	2.24
7,165.00 SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	81,573.53	0.01	4,371.00 DOMINION RESOURCES - REGSITERED	308,354.83	0.05
1,005.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	127,032.00	0.02	27,820.00 DOW - REGISTERED SHS	1,247,519.62	0.21
Autriche	837.68	0.00	32,244.00 DXC TECHNOLOGY	805,729.72	0.13
37.00 ERSTE GROUP BANK AG	837.68	0.00	16,631.00 EDWARDS LIFESCIENCES CORP	1,402,765.81	0.23
Belgique	3,613,385.50	0.60	20,668.00 ELEVANCE HEALTH	9,583,251.49	1.60
21,975.00 KBC GROUPE SA	1,069,303.50	0.18	418.00 ELI LILLY & CO	137,967.95	0.02
240,121.00 PROXIMUS SA	2,544,082.00	0.42	12,447.00 EMERSON ELECTRIC CO	930,300.96	0.16
Espagne	5,207,566.21	0.87	5,366.00 ENTERGY CORP	551,197.45	0.09
18,608.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	44,612.68	0.01	251.00 EPAM SYSTEMS	92,798.13	0.02
98.00 ENDESA	1,511.16	0.00	73,788.00 FEDEX CORP	11,182,875.88	1.87
4,677.00 REPSOL SA	55,211.99	0.01	20,895.00 FIRSTENERGY CORP	789,174.71	0.13
1,512,509.00 TELEFONICA SA	5,106,230.38	0.85	13,483.00 FORTIVE CORP	802,387.49	0.13
Etats-Unis d'Amérique	276,641,470.78	46.21	2,943.00 GARTNER INC	831,213.87	0.14
36,645.00 ABBOTT LABORATORIES	3,619,425.51	0.60	28,252.00 GENERAL MOTORS CO	925,439.37	0.15
73,511.00 ABBVIE INC	10,070,853.17	1.68	129,577.00 HEALTHPEAK PROPERTIES INC	3,031,597.86	0.51
129,035.00 ALPHABET INC -A-	12,598,578.83	2.11	12,327.00 HERSHEY	2,774,188.42	0.46
125,100.00 ALPHABET INC -C-	12,278,226.92	2.05	1,545.00 HOLOGIC INC	101,754.10	0.02
21,734.00 AMEREN CORPORATION	1,787,039.96	0.30	3,613.00 HONEYWELL INTERNATIONAL INC	615,794.02	0.10
35,480.00 AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	3,130,961.06	0.52	41,475.00 HORMEL FOODS CORP	1,923,772.78	0.32
11,375.00 AMERICAN EXPRESS	1,566,479.10	0.26	245.00 ILLUMINA INC	47,714.54	0.01
2,252.00 AMERICAN INTL	109,146.08	0.02	129,708.00 INTEL CORP	3,412,009.55	0.57
2,000.00 AMPHENOL -A-	136,701.88	0.02	9,562.00 INTUIT	3,780,486.75	0.63
14,853.00 ANALOG DEVICES INC	2,112,608.61	0.35	144,526.00 KROGER CO	6,454,358.70	1.08
10,594.00 ANSYS INC	2,397,478.49	0.40	14,094.00 LOWE'S CO INC	2,701,979.42	0.45
46,719.00 APPLE INC	6,590,686.27	1.10	19,459.00 MARATHON PETROLEUM	1,973,013.29	0.33
7,228.00 ARCHER-DANIELS MIDLAND CO	593,571.79	0.10	10,914.00 MARRIOTT INTERNATIONAL -A-	1,561,259.59	0.26
8,765.00 ARTHUR J.GALLAGHER AN CO	1,531,917.83	0.26	65,447.00 META PLATFORMS INC A	9,064,307.62	1.51
109,448.00 AT&T INC	1,713,808.32	0.29	40,941.00 MICROSOFT CORP	9,733,230.13	1.63
495,315.00 BANK OF AMERICA CORP	15,269,242.08	2.56	12,830.00 MID-AMER APARTMENT COMMUNITIES INC	2,030,876.44	0.34
84.00 BANK OF NY MELLON	3,302.89	0.00	2.00 NETFLIX INC	480.66	0.00
27,855.00 BAXTER INTERNATIONAL INC	1,531,435.00	0.26	225.00 NEXTERA ENERGY	18,008.73	0.00
9,990.00 BECTON DICKINSON	2,272,313.28	0.38	742.00 O REILLY AUTO	532,726.69	0.09
6,401.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	1,744,699.66	0.29	28,241.00 OTIS WORLDWIDE CORPORATION	1,839,203.59	0.31
3,197.00 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	231,995.85	0.04	1,261.00 PAYCHEX INC	144,436.08	0.02
1,212.00 BROADRIDGE FINANCIAL SOL -W/I	178,549.32	0.03	1,379.00 PAYCOM SOFTWARE INC	464,508.97	0.08
9,456.00 BROWN AND BROWN INC	583,778.78	0.10	10,125.00 PAYPAL HOLDINGS	889,561.32	0.15
23,290.00 CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	3,885,351.61	0.65	402.00 PEPSICO INC	66,993.84	0.01
634.00 CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	59,649.65	0.01	2,568.00 PERKINELMER	315,426.37	0.05
3,651.00 CHARLES SCHWAB CORP/THE	267,848.08	0.04	812.00 PROCTER & GAMBLE CO	104,644.52	0.02
1,447.00 CHARTER COMM -A-	448,065.58	0.07	47,497.00 PROGRESSIVE CORP	5,634,284.05	0.94
607.00 CINTAS	240,526.03	0.04	3,116.00 PUBLIC STORAGE INC	931,348.91	0.16
13,440.00 CITIGROUP INC	571,678.46	0.10	85,561.00 RAYTHEON TECHNOLOGIES CORPORATION	7,149,516.11	1.19
1,698.00 CME GROUP -A-	307,014.48	0.05	4,286.00 SALESFORCE INC	629,304.59	0.11
119,859.00 CMS ENERGY CORP	7,125,594.00	1.19	165,277.00 SOUTHERN CO	11,472,297.25	1.92
72,246.00 COCA-COLA CO	4,131,292.73	0.69	27,238.00 SOUTHWEST AIRLINES CO - REGISTERED	857,469.42	0.14
1,351.00 CONSTELLATION BRANDS INC -A-	316,743.41	0.05	258.00 SYNOPSIS	80,458.92	0.01
			2,496.00 SYSCO CORP	180,158.38	0.03
			35,328.00 THERMO FISHER SCIENT SHS	18,290,214.18	3.06
			1,541.00 TRACTOR SUPPLY CO	292,391.24	0.05
			14,010.00 TWITTER INC	626,956.97	0.10
			12.00 UNDER ARMOUR INC -A-	81.46	0.00
			33,587.00 UNITEDHEALTH GROUP INC	17,315,141.61	2.90
			50,171.00 VERIZON COMMUNICATIONS INC	1,944,564.76	0.32
			11,796.00 WALGREENS BOOTS	378,088.50	0.06

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
14.00 WASTE MANAGEMENT	2,289.53	0.00	4,553.00 SGS SA REG SHS	10,034,354.91	1.68
11,609.00 WEC ENERGY GR	1,059,758.96	0.18	94,449.00 SONOVA HOLDING NAM-AKT	21,550,280.02	3.59
34,671.00 WELLS FARGO AND CO	1,423,434.51	0.24	16,393.00 SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	7,455,227.65	1.25
9,733.00 WESTROCK	306,897.74	0.05	186,983.00 SWISS RE REGS	14,187,592.08	2.37
1,340.00 ZIMMER BIOMET HLDGS SHS	143,007.20	0.02	13,919.00 SWISSCOM SHS NOM	6,690,994.09	1.12
Finlande	10,437.66	0.00	5,176.00 TEMENOS AG NAM.AKT	362,030.12	0.06
758.00 FORTUM CORP	10,437.66	0.00	91,732.00 THE SWATCH GROUP	21,358,467.12	3.56
France	40,586,472.01	6.78	1,301,927.00 UBS GROUP SA	19,545,108.20	3.26
3,937.00 ACCOR SA	85,078.57	0.01	2,358.00 VAT GROUP SA	498,403.24	0.08
75,210.00 AIR LIQUIDE NOM. PRIME FIDELITE	8,841,687.60	1.48	632.00 ZURICH INSURANCE GROUP NAMENSAKT	258,908.94	0.04
8,273.00 AIR LIQUIDE SA	972,573.88	0.16	Total portefeuille-titres	595,652,515.21	99.48
114,480.00 ENGIE --- REGISTERED LOYALTY BONUS	1,355,672.16	0.23			
30,150.00 L OREAL-ACT REG PROV PRIM.FIDELITE 2013	9,957,037.50	1.66			
122,840.00 ORANGE	1,136,024.32	0.19			
80,450.00 SANOFI	6,307,280.00	1.05			
247,149.00 TOTALENERGIESSE	11,931,117.98	2.00			
Irlande	4,491,102.74	0.75			
16,320.00 LINDE PLC	4,491,102.74	0.75			
Luxembourg	5.62	0.00			
1.00 SES GLOBAL CERT.GC FID.DEP.REC(1-A-SHS)	5.62	0.00			
Panama	93.29	0.00			
13.00 CARNIVAL CORP	93.29	0.00			
Pays-Bas	23,780,711.03	3.97			
922.00 AIRBUS SE	81,956.58	0.01			
19,858.00 ASML HOLDING NV	8,610,428.80	1.44			
344.00 FERRARI NV	65,944.80	0.01			
281,369.00 ING GROUP NV	2,492,366.60	0.42			
432,777.00 KONINKLIJKE KPN NV	1,199,657.84	0.20			
10,234.00 LYONDELLBASELL -A-	786,419.15	0.13			
256,404.00 NN GROUP NV	10,248,467.88	1.71			
6,848.00 STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	84,038.66	0.01			
2,116.00 WOLTERS KLUWER NV	211,430.72	0.04			
Royaume-Uni	9,561,674.79	1.60			
15,547.00 NIELSEN HOLDINGS PLC	439,915.11	0.07			
333,837.00 SHELL PLC	8,557,911.50	1.44			
12,469.00 UNILEVER	563,848.18	0.09			
Suisse	202,574,245.23	33.83			
54,903.00 BALOISE HOLDING REG.SHS	7,214,488.80	1.20			
3,529.00 BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	6,840,594.28	1.14			
8,067.00 BUCHER INDUSTRIES NAMEN AKT	2,603,661.48	0.43			
886.00 CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP PARTIZIPSCH	8,784,650.49	1.47			
216,972.00 DUFREY GROUP	6,834,100.44	1.14			
4,843.00 EMS-CHEM HOLDINGS-NAMEN ACT.	3,156,840.39	0.53			
26,676.00 FLUGHAFEN ZUERICH AG	4,064,202.86	0.68			
23,841.00 GEBERIT AG	10,570,449.60	1.77			
9,313.00 HELVETIA HLDG - REGISTERED SHS	897,301.08	0.15			
5,610.00 KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG	1,175,295.58	0.20			
3,358.00 LONZA GROUP (CHF)	1,693,627.26	0.28			
247,346.00 NOVARTIS AG REG SHS	19,375,693.20	3.24			
25,087.00 PARTNERS GROUP HLDG NAMEN AKT	20,934,453.64	3.50			
13,890.00 ROCHE HOLDING LTD	4,659,531.74	0.78			
11,397.00 SCHINDLER HOLDING SA	1,827,988.02	0.31			

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	776,248,294.13	101.96	919.00 COPART INC	99,812.79	0.01
Actions	776,248,294.13	101.96	1,366.00 COSTCO WHOLESALE CORP	658,521.74	0.09
Allemagne	5,480,328.11	0.72	129.00 DOW - REGISTERED SHS	5,784.69	0.00
72,843.00 BAYER AG REG SHS	3,453,850.85	0.45	2.00 DXC TECHNOLOGY	49.98	0.00
7,620.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	58,262.52	0.01	1.00 EDWARDS LIFESCIENCES CORP	84.35	0.00
4,821.00 FRESENIUS SE	105,820.95	0.01	2,193.00 ELEVANCE HEALTH	1,016,841.04	0.13
36.00 NEMETSCHKE	1,772.28	0.00	2,616.00 ENTERGY CORP	268,716.46	0.04
3,662.00 PORSCHE AUTOMOBIL HLDG - VORZ.AKT-STIMMR	212,981.92	0.03	1,849.00 EQUITABLE HOLDINGS INC	49,733.22	0.01
27,625.00 RWE AG	1,043,948.75	0.14	1.00 EXPEDIA GROUP INC	95.64	0.00
2,278.00 SAP AG	191,625.36	0.03	18,260.00 GAMING AND LEISURE PROPERTIES	824,603.07	0.11
1,288.00 SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	14,663.88	0.00	92,996.00 HALLIBURTON	2,337,121.95	0.31
3,144.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	397,401.60	0.05	1,249.00 HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIESINC	282,400.35	0.04
Danemark	6,551,218.07	0.86	14,932.00 IDEX CORP	3,046,149.34	0.40
792.00 GENMAB AS	262,137.73	0.03	1.00 INCYTE CORP	68.02	0.00
61,416.00 NOVO NORDISK	6,289,080.34	0.83	40,100.00 INTEL CORP	1,054,843.06	0.14
Espagne	132,342,825.93	17.38	3,284.00 INTUITIVE SURGICAL	628,339.67	0.08
197,601.00 AENA SME SA	21,123,546.90	2.77	7,684.00 JOHNSON & JOHNSON	1,281,333.37	0.17
28,812,222.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	69,077,302.25	9.08	8,193.00 KEYSIGHT TECHNOLOGIES	1,316,031.73	0.17
372,767.00 ENAGAS	5,904,629.28	0.78	3,113.00 KIMBERLY-CLARK CORP	357,614.47	0.05
244,084.00 ENDESA	3,763,775.28	0.49	4,994.00 KINDER MORGAN INC	84,826.38	0.01
182,116.00 FERROVIAL SA	4,259,693.24	0.56	40,973.00 KROGER CO	1,829,805.29	0.24
272,439.00 RED ELECTRICA	4,280,016.69	0.56	4,970.00 LIBERTY MEDIA -C- SIRIUS XM	191,311.90	0.03
890,133.00 REPSOL SA	10,508,020.07	1.38	14,476.00 MARATHON PETROLEUM	1,467,770.20	0.19
3,976,849.00 TELEFONICA SA	13,425,842.22	1.76	126.00 MARKEL CORP	139,449.52	0.02
Etats-Unis d'Amérique	137,022,640.74	18.00	3,600.00 MCKESSON CORP	1,248,948.09	0.16
1,210.00 ABIOMED INC	303,423.26	0.04	46,450.00 MERCK & CO INC	4,083,370.59	0.54
20,501.00 ACTIVISION BLIZZARD	1,555,702.89	0.20	28,333.00 META PLATFORMS INC A	3,924,076.39	0.52
5,127.00 ADOBE INC	1,440,259.68	0.19	2,103.00 MICROCHIP TECHNOLOGY	131,012.19	0.02
21,677.00 ALCOA WHEN ISSUED	744,804.59	0.10	11,978.00 MICROSOFT CORP	2,847,625.38	0.37
54,346.00 ALPHABET INC -A-	5,306,175.57	0.70	15,187.00 MOSAIC	749,234.63	0.10
119,460.00 ALPHABET INC -C-	11,724,676.16	1.53	1,925.00 NETFLIX INC	462,636.66	0.06
12,119.00 AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	1,069,450.88	0.14	1,990.00 NEXTERA ENERGY	159,277.19	0.02
33,415.00 AMERICAN INTL	1,619,501.05	0.21	33,934.00 NIKE INC	2,879,185.51	0.38
9,453.00 AMGEN INC	2,174,966.77	0.29	9,045.00 NORFOLK SOUTHERN	1,935,675.24	0.25
1,571.00 AMPHENOL -A-	107,379.33	0.01	1,783.00 NVIDIA CORP	220,934.38	0.03
55,398.00 APPLE INC	7,815,039.66	1.03	1,972.00 O REILLY AUTO	1,415,818.10	0.19
23,320.00 APPLIED MATERIALS INC	1,950,296.13	0.26	7,643.00 ORACLE CORP	476,453.85	0.06
7,833.00 AQUA AMERICA --- REGISTERED SHS	330,862.59	0.04	5,028.00 OWENS CORNING SHS	403,461.52	0.05
1,186.00 ARISTA NETWORKS INC	136,668.75	0.02	3,002.00 PAYCOM SOFTWARE INC	1,011,208.06	0.13
4,621.00 AUTODESK INC	881,133.87	0.12	15,319.00 PAYPAL HOLDINGS	1,345,895.30	0.18
37,637.00 AVERY DENNISON CORP	6,250,742.51	0.82	30,202.00 PEPSICO INC	5,033,204.23	0.66
192.00 BECTON DICKINSON	43,672.09	0.01	24.00 PFIZER INC	1,072.06	0.00
14,219.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	3,875,626.38	0.51	22,523.00 PROGRESSIVE CORP	2,671,768.32	0.35
2,794.00 BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	241,767.35	0.03	32,147.00 QORVO INC	2,605,821.74	0.34
9,645.00 BOSTON SCIENTIF CORP	381,310.52	0.05	6,578.00 QUALCOMM INC	758,620.36	0.10
19,493.00 BROADCOM INC - REGISTERED SHS	8,834,876.67	1.16	2,252.00 SERVICENOW INC	868,042.38	0.11
1,860.00 CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	310,294.29	0.04	1,427.00 SNOWFLAKE INC-CLASS A	247,570.99	0.03
21,457.00 CHENIERE ENERGY INC	3,633,880.33	0.48	14,094.00 SYSCO CORP	1,017,288.56	0.13
16,405.00 CHEVRON CORP	2,405,865.72	0.32	3,861.00 T MOBILE USA INC	528,791.27	0.07
1,424.00 CINTAS	564,265.36	0.07	1.00 TELEFLEX INC	205.64	0.00
26,862.00 CMS ENERGY CORP	1,596,940.62	0.21	6,852.00 THERMO FISHER SCIENT SHS	3,547,456.62	0.47
49,001.00 CONSOLIDATED EDISON INC	4,289,619.52	0.56	1,581.00 TRADEWEB MKTS/REGSH	91,052.95	0.01
3,271.00 CONSTELLATION BRANDS INC -A-	766,889.48	0.10	11,000.00 TRIMBLE	609,370.69	0.08
			9.00 UNDER ARMOUR INC -A-	61.09	0.00
			6,076.00 UNITED RENTALS INC	1,675,342.34	0.22
			87,391.00 VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,387,165.08	0.44
			2,172.00 WASTE MANAGEMENT	355,204.53	0.05

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets		
	EUR			EUR			
15,274.00	WEC ENERGY GR	1,394,328.40	0.18	533,555.00	NIBE INDUSTRIER	4,912,672.46	0.65
3,735.00	WESTLAKE --- REGISTERED SHS	331,237.48	0.04	424,000.00	SKF AB -B-	5,859,828.08	0.77
21,790.00	WESTROCK	687,075.08	0.09	395,297.00	SVENSKA CELLULOZA SCA AB-SHS-B-	5,163,169.71	0.68
1,952.00	WHIRLPOOL CORP	268,615.44	0.04	477,649.00	TELE2 AB	4,217,787.00	0.55
8,257.00	ZOOMINFO TECH --- REGISTERED SHS -A-	351,132.16	0.05		Suisse	3,061,573.50	0.40
	Finlande	317,682.90	0.04	25.00	BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	48,459.86	0.01
6,854.00	ELISA CORPORATION -A-	317,682.90	0.04	2,330.00	NESTLE SA REG SHS	258,760.01	0.03
	France	322,789,484.09	42.41	2,631.00	NOVARTIS AG REG SHS	206,097.73	0.03
8,370.00	ACCOR SA	180,875.70	0.02	660.00	ROCHE HOLDING LTD	221,403.24	0.03
297,657.00	AIR LIQUIDE NOM. PRIME FIDELITE	34,992,556.92	4.60	2,636.00	SWISSCOM SHS NOM	1,267,149.97	0.17
173,892.00	AXA SA	3,908,222.70	0.51	314.00	TE CONNECTIVITY LTD REG SHS	35,372.88	0.00
38,292.00	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	886,651.26	0.12	14,645.00	TEMENOS AG NAM.AKT	1,024,329.81	0.13
893,393.00	ENGIE SA	10,579,559.91	1.39		Total portefeuille-titres	776,248,294.13	101.96
22,981.00	ESSILORLUXOTTICA SA	3,225,383.35	0.42				
227,662.00	L OREAL-ACT REG PROV PRIM.FIDELITE 2013	75,185,375.50	9.89				
73,247.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	44,709,968.80	5.87				
261,167.00	ORANGE	2,415,272.42	0.32				
27,000.00	RENAULT SA	755,190.00	0.10				
427,408.00	SANOFI	33,508,787.20	4.40				
490,000.00	SCHNEIDER ELECTRIC SE	57,300,600.00	7.53				
775,623.00	TOTALENERGIESSE	37,443,200.33	4.92				
2,220,000.00	VIVENDI SA	17,697,840.00	2.32				
	Irlande	11,200,984.09	1.47				
4,416.00	ACCENTURE - SHS CLASS A	1,159,839.53	0.15				
31,228.00	LINDE PLC	8,593,637.03	1.13				
17,561.00	MEDTRONIC HLD	1,447,507.53	0.19				
	Italie	69,441,083.98	9.12				
3,680,378.00	ENI SPA	40,152,923.98	5.27				
17,200,000.00	INTESA SANPAOLO	29,288,160.00	3.85				
	Luxembourg	1,769,042.21	0.23				
251,059.00	SES GLOBAL CERT.GC FID.DEP.REC(1-A-SHS)	1,410,449.46	0.18				
27,033.00	TENARIS SA - REG.SHS	358,592.75	0.05				
	Panama	64.58	0.00				
9.00	CARNIVAL CORP	64.58	0.00				
	Pays-Bas	35,232,861.44	4.63				
191,539.00	AIRBUS SE	17,025,901.71	2.24				
7,570.00	JDE PEET S BV	226,645.80	0.03				
1,025.00	LYONDELLBASELL -A-	78,764.87	0.01				
163,696.00	STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	2,009,532.10	0.26				
1,289,950.00	STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	15,830,266.40	2.08				
618.00	WOLTERS KLUWER NV	61,750.56	0.01				
	Royaume-Uni	8,486,115.42	1.11				
50,197.00	RELX PLC	1,257,936.82	0.17				
155,037.00	SHELL PLC	3,974,373.50	0.51				
71,955.00	UNILEVER	3,253,805.10	0.43				
	Suède	42,552,389.07	5.59				
515,496.00	BILLERUDKORSNAS AB	6,230,533.03	0.81				
212,000.00	BOLIDEN --- REGISTERED SHS	6,757,815.05	0.88				
320,000.00	EPIROC REGISTERED SHS -B-	4,150,243.98	0.55				
58,191.00	ESSITY AB REGISTERED -B-	1,181,842.02	0.16				
50,000.00	EVOLUTION AB	4,078,497.74	0.54				

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	2,052,719,392.45	101.52	Etats-Unis d'Amérique	130,412,616.55	6.45
Actions	2,052,719,392.45	101.52	3,966.00 ABBOTT LABORATORIES	391,721.70	0.02
Allemagne	101,279,844.81	5.01	10,618.00 ACTIVISION BLIZZARD	805,738.91	0.04
42,172.00 AURUBIS	2,276,444.56	0.11	1,252.00 ADOBE INC	351,707.65	0.02
38,230.00 BASF SE REG SHS	1,513,908.00	0.07	1.00 AKAMAI TECHNOLOGIES	81.99	0.00
38,345.00 BAYER AG REG SHS	1,818,128.18	0.09	27,802.00 ALPHABET INC -A-	2,714,501.40	0.13
11,050.00 BRENNTAG - NAMEN AKT	689,299.00	0.03	31,520.00 ALPHABET INC -C-	3,093,602.82	0.15
13,826.00 CARL ZEISS MEDITEC AG	1,485,603.70	0.07	8,107.00 AMEREN CORPORATION	666,583.83	0.03
64,577.00 CONTINENTAL AG	2,967,313.15	0.15	29,095.00 AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	2,567,511.61	0.13
2,373,346.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	18,146,603.52	0.91	2,300.00 AMPHENOL -A-	157,207.17	0.01
250,815.00 DEUTSCHE LUFTHANSA AG REG SHS	1,484,323.17	0.07	1,000.00 ANSYS INC	226,305.31	0.01
461,647.00 E.ON SE	3,645,164.71	0.18	17,849.00 A.O.SMITH CORP	885,116.54	0.04
47,005.00 FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	1,364,555.15	0.07	35,588.00 APPLE INC	5,020,427.30	0.26
68,654.00 HEIDELBERGCEMENT AG	2,804,515.90	0.14	32,659.00 AQUA AMERICA --- REGISTERED SHS	1,379,502.29	0.07
42,741.00 HUGO BOSS AG	2,054,132.46	0.10	132,443.00 AT&T INC	2,073,879.06	0.10
8,228.00 INFINEON TECHNOLOGIES REG SHS	186,857.88	0.01	488.00 AUTODESK INC	93,052.01	0.00
52,569.00 KION GROUP AG	1,041,654.74	0.05	4,056.00 AVERY DENNISON CORP	673,619.35	0.03
30,786.00 NEMETSCHKE	1,515,594.78	0.07	268.00 BECTON DICKINSON	60,958.95	0.00
34,927.00 PORSCHE AUTOMOBIL HLDG - VORZ.AKT-STIMMR	2,031,354.32	0.10	2,517.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	686,050.47	0.03
289,545.00 RWE AG	10,941,905.55	0.54	5,956.00 BIOGEN IDEC INC	1,623,285.87	0.08
348,135.00 SAP AG	29,285,116.20	1.46	12,284.00 BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	1,062,945.62	0.05
114,742.00 SCOUT24	5,934,456.24	0.29	2,920.00 BLACKROCK INC	1,640,195.58	0.08
79,849.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	10,092,913.60	0.50	44,543.00 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	3,232,339.99	0.16
Autriche	10,181,197.65	0.50	19,536.00 CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	3,259,090.98	0.16
38,379.00 ANDRITZ AG	1,674,859.59	0.08	5,045.00 CBOE HOLDINGS INC	604,431.84	0.03
173,497.00 OMV AG	6,483,582.89	0.32	35,323.00 CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	3,470,462.67	0.17
115,520.00 VOESTALPINE AG	2,022,755.20	0.10	9,129.00 CHENIERE ENERGY INC	1,546,054.60	0.08
Belgique	22,885,377.75	1.13	6,595.00 CHEVRON CORP	967,185.88	0.05
124,309.00 KBC GROUPE SA	6,048,875.94	0.30	36.00 CHIPOTLE MEXICAN GRILL -A-	55,223.15	0.00
881,094.00 PROXIMUS SA	9,335,190.93	0.46	2,723.00 CINTAS	1,078,999.00	0.05
105,474.00 UCB	7,501,310.88	0.37	454,622.00 COCA-COLA CO	25,996,962.63	1.30
Danemark	17,378,822.79	0.86	16,355.00 COLGATE-PALMOLIVE CO	1,172,805.34	0.06
76.00 A.P. MOELLER-MAERSK A/S -B-	141,718.39	0.01	4,680.00 CONSTELLATION BRANDS INC -A-	1,097,231.05	0.05
5,862.00 DSV A/S	706,393.29	0.03	942.00 CONSTELLATION ENERGY	79,992.83	0.00
1,358.00 GENMAB AS	449,473.54	0.02	7,597.00 COSTCO WHOLESALE CORP	3,662,364.30	0.18
135,636.00 NOVO NORDISK	13,889,307.36	0.69	398.00 DOMINION RESOURCES - REGSITERED	28,077.15	0.00
103,875.00 TRYG A/S	2,191,930.21	0.11	201.00 DOW - REGISTERED SHS	9,013.35	0.00
Espagne	341,457,368.82	16.89	710.00 DUKE ENERGY CORP	67,416.12	0.00
173,444.00 ACS	4,011,759.72	0.20	31,016.00 DXC TECHNOLOGY	775,043.82	0.04
145,971.00 AENA SME SA	15,604,299.90	0.77	2,791.00 ELEVANCE HEALTH	1,294,119.17	0.06
297.00 AMADEUS IT GROUP SA -A-	14,229.27	0.00	1,966.00 ELI LILLY & CO	648,911.45	0.03
3,922,954.00 BANCO SABADELL REG.SHS	2,700,561.53	0.13	5,327.00 EMERSON ELECTRIC CO	398,145.19	0.02
27,932,924.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	66,969,185.29	3.31	33,452.00 EQT	1,391,485.73	0.07
11,755,029.00 CAIXABANK SA	38,920,901.02	1.92	2,680.00 EVERGY	162,498.85	0.01
290,699.00 ENAGAS	4,604,672.16	0.23	20,276.00 EXPEDIA GROUP INC	1,939,119.52	0.10
854,830.00 ENDESA	13,181,478.60	0.65	521.00 FEDEX CORP	78,959.70	0.00
481,073.00 GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA SA	8,623,233.53	0.43	78,922.00 FIRSTENERGY CORP	2,980,772.72	0.15
155,549.00 INDITEX SHARE FROM SPLIT	3,310,082.72	0.16	11,762.00 FREEPORT MCMORAN COPPER AND GOLD INC	328,132.97	0.02
728,247.00 RED ELECTRICA	11,440,760.37	0.57	6,174.00 GARTNER INC	1,743,769.77	0.09
9,049,435.00 REPSOL SA	106,828,580.18	5.29	31,774.00 GENERAL MOTORS CO	1,040,808.10	0.05
19,326,903.00 TELEFONICA SA	65,247,624.53	3.23	2,128.00 HENRY JACK AND ASSOCIATES INC	395,927.69	0.02
			19,227.00 HOLOGIC INC	1,266,295.15	0.06
			6,777.00 HOME DEPOT INC	1,908,891.32	0.09
			9,499.00 HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,618,994.57	0.08
			10,783.00 INCYTE CORP	733,505.97	0.04
			54,741.00 INTEL CORP	1,439,979.15	0.07
			3,081.00 INTUITIVE SURGICAL	589,498.94	0.03

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets		
	EUR			EUR			
14,451.00	JOHNSON & JOHNSON	2,409,753.85	0.12	124,293.00	LEGRAND SA	8,285,371.38	0.41
7,177.00	KIMBERLY-CLARK CORP	824,477.70	0.04	50,246.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	30,670,158.40	1.52
24,674.00	KROGER CO	1,101,911.40	0.05	855,358.00	ORANGE	7,910,350.78	0.39
767.00	LULULEMON ATHLETICA INC SHS WHEN ISSUED	218,876.66	0.01	275,151.00	SANOFI	21,571,838.40	1.07
2,266.00	MARKETAXESS HOLDING INC	514,635.17	0.03	10,787.00	SCOR SE ACT PROV REGROUPEMENT	160,348.76	0.01
1,745.00	MERCADOLIBRE	1,474,481.80	0.07	361,806.00	SOCIETE GENERALE SA	7,386,269.49	0.37
5,449.00	META PLATFORMS INC A	754,678.02	0.04	652,668.00	TOTALENERGIESSE	31,507,547.70	1.55
8,864.00	METLIFE INC	549,945.31	0.03	350,000.00	VIVENDI SA	2,790,200.00	0.14
224.00	METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	247,887.39	0.01		Irlande	43,404,807.16	2.15
1,275.00	MOSAIC	62,900.78	0.00	68,975.00	ACCENTURE - SHS CLASS A	18,115,926.61	0.91
4,249.00	MSCI INC -A-	1,829,414.29	0.09	220.00	ALLEGION PLC WI	20,139.44	0.00
565.00	NETFLIX INC	135,786.86	0.01	15,386.00	AON - REGISTERED SHS (USD)	4,207,061.52	0.21
7,292.00	NIKE INC	618,701.62	0.03	10,711.00	EATON CORPORATION PUBLIC LIMITED COMPANY	1,458,091.11	0.07
2,386.00	NORDSON	516,997.11	0.03	52,368.00	LINDE PLC	14,411,156.15	0.71
181.00	OTIS WORLDWIDE CORPORATION	11,787.68	0.00	46,706.00	MEDTRONIC HLD	3,849,854.03	0.19
24,744.00	OWENS CORNING SHS	1,985,531.40	0.10	31,117.00	PENTAIR PLC	1,290,546.33	0.06
6,187.00	PAYPAL HOLDINGS	543,576.88	0.03	352.00	TRANE TECH - REGISTERED SHS	52,031.97	0.00
5,231.00	PEPSICO INC	871,753.24	0.04		Israël	184,199,482.44	9.11
897.00	PFIZER INC	40,068.11	0.00	235,300.00	AZRIELI GROUP	16,489,535.53	0.82
3,939.00	PROCTER & GAMBLE CO	507,629.00	0.03	1,960,806.00	BANK LEUMI LE-ISRAEL (IL604611)	17,229,816.40	0.85
11,082.00	PTC INC	1,183,256.47	0.06	2,019,864.00	ICL GROUP LTD	16,693,809.48	0.83
714.00	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	40,982.21	0.00	7,375,000.00	ISRAEL DISCOUNT BANK LTD. -A-	38,222,633.55	1.89
30,070.00	QUALCOMM INC	3,467,879.96	0.17	129,000.00	NICE SYSTEMS LTD (IL273011)	25,158,452.07	1.24
392.00	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	21,299.61	0.00	6,694,884.00	TEVA PHARMACEUTICAL IND.UNITS 1 UT =1SH	52,642,251.47	2.60
35,411.00	SOUTHERN CO	2,457,967.64	0.12	397,290.00	TOWER SEMICONDUCTOR	17,762,983.94	0.88
2,181.00	SYNOPSIS	680,158.54	0.03		Italie	205,643,490.43	10.17
4,398.00	TELEFLEX INC	904,426.15	0.04	1,597,500.00	ATLANTIA SPA	36,119,475.00	1.79
29,717.00	TWITTER INC	1,329,855.85	0.07	8,603,000.00	BANCO BPM REGISTERED	23,176,482.00	1.15
512.00	TYLER TECHNOLOGIES INC	181,615.88	0.01	4,264,000.00	ENEL SPA	18,011,136.00	0.89
50,347.00	UDR	2,143,595.54	0.11	3,112,500.00	ENI SPA	33,957,375.00	1.68
3,851.00	ULTA BEAUTY RG REGISTERED	1,577,076.19	0.08	17,220,833.00	INTESA SANPAOLO	29,323,634.43	1.45
28,395.00	UNDER ARMOUR INC -A-	192,749.20	0.01	2,906,000.00	POSTE ITALIANE SPA	22,637,740.00	1.12
994.00	UNION PACIFIC CORP	197,673.74	0.01	4,056,000.00	UNICREDIT SPA REGS	42,417,648.00	2.09
1,316.00	VULCAN MATERIALS CO	211,857.66	0.01		Luxembourg	2,966,174.79	0.15
6,199.00	WABTEC CORP	514,764.10	0.03	527,977.00	SES GLOBAL CERT.GC FID.DEP.REC(1-A-SHS)	2,966,174.79	0.15
13,549.00	WARNER BROS DISCOVERY INC	159,050.17	0.01		Norvège	17,832,276.40	0.88
869.00	WASTE MANAGEMENT	142,114.52	0.01	96,857.00	EQUINOR ASA	3,248,980.53	0.16
12,261.00	WEC ENERGY GR	1,119,278.55	0.06	537,645.00	MOWI ASA	6,975,207.95	0.35
36,879.00	WELLS FARGO AND CO	1,514,085.01	0.07	551,991.00	ORKLA ASA	4,095,141.89	0.20
3,158.00	ZEBRA TECHNOLOGIES -A-	844,615.51	0.04	97,841.00	YARA INTERNATIONAL ASA	3,512,946.03	0.17
72,216.00	ZOOMINFO TECH --- REGISTERED SHS -A-	3,071,013.69	0.15		Panama	43.06	0.00
	Finlande	83,954,285.71	4.15	6.00	CARNIVAL CORP	43.06	0.00
416,799.00	ELISA CORPORATION -A-	19,318,633.65	0.96		Pays-Bas	499,161,227.43	24.68
244,019.00	FORTUM CORP	3,360,141.63	0.17	478,164.00	AEGON NV	1,961,428.73	0.10
46,026.00	KESKO CORP	881,167.77	0.04	1,190,533.00	AIRBUS SE	105,826,478.37	5.24
2,322.00	ORION CORPORATION (NEW) -B-	100,031.76	0.00	242,413.00	AKZO NOBEL NV	14,137,526.16	0.70
770,184.00	STORA ENSO -R-	10,081,708.56	0.50	5,749.00	ARGENX SE	2,118,506.50	0.10
1,502,539.00	UPM KYMMENE CORP	48,952,720.62	2.42	86,836.00	ASML HOLDING NV	37,652,089.60	1.86
60,484.00	VALMET CORPORATION	1,259,881.72	0.06	917,127.00	CNH INDUSTRIAL NV	10,666,187.01	0.53
	France	166,824,452.65	8.25	124,326.00	DSM KONINKLIJKE	14,602,088.70	0.72
2,768.00	ACCOR SA	59,816.48	0.00	63,177.00	EURONEXT NV	4,112,822.70	0.20
82,740.00	AIR LIQUIDE NOM. PRIME FIDELITE	9,726,914.40	0.48	5,453.00	EXOR REG	357,062.44	0.02
450,000.00	AXA SA	10,113,750.00	0.50				
229,000.00	DANONE SA	11,122,530.00	0.55				
1,497.00	EDF SA	17,799.33	0.00				
2,153,484.00	ENGIE --- REGISTERED LOYALTY BONUS	25,501,557.53	1.26				

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR	
83,426.00 FERRARI NV	15,992,764.20	0.79
6,432.00 HEINEKEN HOLDING	453,456.00	0.02
20,259.00 HEINEKEN NV	1,820,473.74	0.09
4,595,093.00 ING GROUP NV	40,703,333.79	2.01
1,844,303.00 JDE PEET S BV	55,218,431.82	2.73
1,235,818.00 KONINKLIJKE KPN NV	3,425,687.50	0.17
11,267.00 LYONDELLBASELL -A-	865,798.76	0.04
382,999.00 NN GROUP NV	15,308,470.03	0.76
250,756.00 PROSUS NV	13,533,301.32	0.67
779,780.00 ROYAL PHILIPS NV	12,476,480.00	0.62
678,912.00 STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	8,331,608.06	0.41
3,249,414.00 STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	39,889,806.26	1.97
1,446,518.00 STMICROELECTRONICS	46,650,205.50	2.31
530,997.00 WOLTERS KLUWER NV	53,057,220.24	2.62
Portugal	13,844,217.48	0.68
3,118,067.00 EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA - REG.SHS	13,844,217.48	0.68
Royaume-Uni	41,363,635.09	2.05
134,078.00 RELX PLC	3,359,994.68	0.17
1,258,015.00 SHELL PLC	32,249,214.53	1.60
127,254.00 UNILEVER	5,754,425.88	0.28
Suède	127,766,232.77	6.32
2,412,000.00 ATLAS COPCO AB	23,251,079.64	1.15
1,406,000.00 HEXAGON --- REGISTERED SHS -B-	13,540,557.32	0.67
62,481.00 HOLMEN -REGISTERED SHS	2,439,665.05	0.12
1,287,000.00 INVESTOR --- REGISTERED SHS -B-	19,364,812.15	0.96
2,476,000.00 SVENSKA HANDELSBANKEN AB-A-	20,866,300.88	1.03
2,227,000.00 SWEDBANK -A-	30,081,445.78	1.49
3,025,000.00 TELEFON ERICSSON	18,222,371.95	0.90
Suisse	42,163,838.67	2.09
286.00 CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP PARTIZIPSCH	2,835,677.25	0.14
469.00 CHUBB - NAMEN AKT	87,073.67	0.00
4,802.00 LONZA GROUP (CHF)	2,421,917.24	0.12
34,202.00 NESTLE SA REG SHS	3,798,330.39	0.19
208,002.00 NOVARTIS AG REG SHS	16,293,705.72	0.82
25,063.00 ROCHE HOLDING LTD	8,407,620.15	0.42
2,165.00 SONOVA HOLDING NAM-AKT	493,984.65	0.02
110,731.00 TEMENOS AG NAM.AKT	7,744,968.51	0.38
346.00 THE SWATCH GROUP	80,561.09	0.00
Autres valeurs mobilières	856.08	0.00
Actions	856.08	0.00
France	856.08	0.00
72.00 ELECTRICITE DE FRANCE PRIME FIDEL 2024	856.08	0.00
Total portefeuille-titres	2,052,720,248.53	101.52

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	90,267,154.71	99.39	5,980.00 VERIZON COMMUNICATIONS INC	231,777.27	0.26
Actions	90,267,154.71	99.39	France	10,596,718.02	11.67
Allemagne	10,474,492.13	11.53	2,496.00 ACCOR SA	53,938.56	0.06
418,542.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	3,200,172.13	3.52	83,338.00 AXA SA	1,873,021.55	2.06
57,550.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	7,274,320.00	8.01	123,672.00 CARREFOUR SA	1,757,997.48	1.94
Etats-Unis d'Amérique	63,718,351.09	70.17	21,650.00 DANONE SA	1,051,540.50	1.16
84,796.00 ALPHABET INC -A-	8,279,219.52	9.11	72,586.00 ENGIE --- REGISTERED LOYALTY BONUS	859,563.41	0.95
36,852.00 ALPHABET INC -C-	3,616,924.21	3.98	77,887.00 ORANGE	720,298.98	0.79
830.00 AMERICAN EXPRESS	301,932.94	0.13	27,398.00 SANOFI	2,148,003.20	2.36
4,502.00 AMGEN INC	1,035,829.94	1.14	30,025.00 TOTALENERGIESSE	1,449,456.88	1.60
6,345.00 APPLE INC	895,094.17	0.99	85,662.00 VIVENDI SA	682,897.46	0.75
8,772.00 APPLIED MATERIALS INC	733,619.11	0.81	Irlande	3,428,440.36	3.77
10,179.00 ARISTA NETWORKS INC	1,172,977.40	1.29	25,185.00 EATON CORPORATION PUBLIC LIMITED COMPANY	3,428,440.36	3.77
15,682.00 AT&T INC	245,559.01	0.27	Luxembourg	16.85	0.00
1,818.00 AVERY DENNISON CORP	301,932.94	0.33	3.00 SES GLOBAL CERT.GC FID.DEP.REC(1-A-SHS)	16.85	0.00
10,352.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	2,821,610.82	3.11	Panama	28.70	0.00
1.00 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	72.57	0.00	4.00 CARNIVAL CORP	28.70	0.00
12,414.00 CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	2,070,964.14	2.28	Pays-Bas	1,701,532.38	1.87
4,647.00 CHENIERE ENERGY INC	786,999.20	0.87	19,142.00 AIRBUS SE	1,701,532.38	1.87
1,822.00 CINTAS	721,974.36	0.79	Royaume-Uni	306,719.91	0.34
5,778.00 CITIGROUP INC	245,770.69	0.27	2,935.00 SHELL PLC	75,238.73	0.08
89,027.00 COCA-COLA CO	5,090,892.20	5.60	5,119.00 UNILEVER	231,481.18	0.26
7,721.00 CORTEVA - REGISTERED SHS	450,421.22	0.50	Suisse	40,855.27	0.04
1,704.00 COSTCO WHOLESALE CORP	821,464.89	0.90	4.00 BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	7,753.58	0.01
85,209.00 CSX CORP	2,317,121.18	2.55	50.00 NOVARTIS AG REG SHS	3,916.72	0.00
19,864.00 DOW - REGISTERED SHS	890,752.33	0.98	87.00 ROCHE HOLDING LTD	29,184.97	0.03
9.00 DXC TECHNOLOGY	224.90	0.00	Total portefeuille-titres	90,267,154.71	99.39
86,838.00 EBAY INC	3,262,906.94	3.59			
3,185.00 ELEVANCE HEALTH	1,476,807.43	1.63			
49,310.00 EQT	2,051,122.85	2.26			
6,162.00 FEDEX CORP	933,876.53	1.03			
373.00 HENRY JACK AND ASSOCIATES INC	69,398.98	0.08			
491.00 HERSHEY	110,499.43	0.12			
8,347.00 ILLUMINA INC	1,625,605.20	1.79			
93,957.00 INTEL CORP	2,471,568.31	2.72			
4,683.00 INTUITIVE SURGICAL	896,015.43	0.99			
6,466.00 KIMBERLY-CLARK CORP	742,799.61	0.82			
22,576.00 MARATHON PETROLEUM	2,289,056.38	2.52			
8,121.00 META PLATFORMS INC A	1,124,745.86	1.24			
98.00 MICROSOFT CORP	23,298.32	0.03			
1,021.00 MORGAN STANLEY	82,344.93	0.09			
6,202.00 NEXTERA ENERGY	496,400.57	0.55			
48,596.00 NIKE INC	4,123,206.78	4.54			
11,503.00 PEPSICO INC	1,916,990.54	2.11			
7.00 PFIZER INC	312.68	0.00			
2.00 QORVO INC	162.12	0.00			
11,472.00 QUALCOMM INC	1,323,030.23	1.46			
2,889.00 SYSCO CORP	208,524.67	0.23			
3,921.00 T MOBILE USA INC	537,008.70	0.59			
6,858.00 TESLA MOTORS INC	1,856,871.84	2.04			
6,207.00 THERMO FISHER SCIENT SHS	3,213,523.53	3.54			
10.00 UNDER ARMOUR INC -A-	67.88	0.00			
148.00 UNION PACIFIC CORP	29,432.31	0.03			
41.00 VERISIGN INC	7,269.64	0.01			

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	455,602,712.99	113.23	26,963.00 COSTCO WHOLESALE CORP	12,998,332.07	3.23
Actions	455,602,712.99	113.23	154,949.00 CSX CORP	4,213,587.87	1.05
Allemagne	43,262,882.85	10.75	160.00 DOW - REGISTERED SHS	7,174.81	0.00
107,437.00 ALLIANZ SE REG SHS	17,383,306.60	4.32	6,994.00 DUKE ENERGY CORP	664,096.24	0.17
414,740.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	3,171,102.04	0.79	12.00 DXC TECHNOLOGY	299.86	0.00
752.00 FRESENIUS SE	16,506.40	0.00	24,523.00 EDWARDS LIFESCIENCES CORP	2,068,428.00	0.51
1,259.00 PORSCHE AUTOMOBIL HLDG - VORZ.AKT-STIMMR	73,223.44	0.02	32,709.00 ELI LILLY & CO	10,796,156.94	2.68
902.00 RWE AG	34,086.58	0.01	5,545.00 ENTERGY CORP	569,584.39	0.14
1.00 SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	11.39	0.00	137,427.00 EQT	5,716,480.63	1.42
178,676.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	22,584,646.40	5.61	14,342.00 EXPEDIA GROUP INC	1,371,614.33	0.34
Autriche	5,841.12	0.00	107,091.00 FIFTH THIRD BANCORP	3,493,725.68	0.87
258.00 ERSTE GROUP BANK AG	5,841.12	0.00	52,307.00 FIRSTENERGY CORP	1,975,561.68	0.49
Belgique	74,974.72	0.02	45,489.00 GENERAL MILLS INC	3,557,303.41	0.88
269.00 COFINIMMO SA	22,811.20	0.01	20,141.00 HUMANA INC	9,975,207.26	2.48
1,072.00 KBC GROUPE SA	52,163.52	0.01	625.00 ILLUMINA INC	121,720.77	0.03
Danemark	41,023.74	0.01	276,571.00 INTEL CORP	7,275,286.76	1.81
22.00 A.P. MOELLER-MAERSK A/S-B-	41,023.74	0.01	13,399.00 JOHNSON & JOHNSON	2,234,329.24	0.56
Espagne	23,027,068.37	5.72	30,916.00 KROGER CO	1,380,671.67	0.34
9,342,562.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	22,398,792.40	5.56	99,030.00 LIBERTY MEDIA -C- SIRIUS XM	3,811,995.41	0.95
9,906.00 ENDESA	152,750.52	0.04	9,757.00 LOWE'S CO INC	1,870,527.40	0.46
23,726.00 REPSOL SA	280,085.43	0.07	2,795.00 LULULEMON ATHLETICA INC SHS WHEN ISSUED	797,601.39	0.20
57,891.00 TELEFONICA SA	195,440.02	0.05	40,666.00 MARATHON PETROLEUM	4,123,262.17	1.02
Etats-Unis d'Amérique	314,946,444.54	78.29	1,470.00 MERCADOLIBRE	1,242,113.61	0.31
28,996.00 ABBOTT LABORATORIES	2,863,934.02	0.71	86,837.00 MERCK & CO INC	7,633,749.24	1.90
15,598.00 ACTIVISION BLIZZARD	1,183,642.44	0.29	39,897.00 MICROSOFT CORP	9,485,031.69	2.36
333,323.00 ALCOA WHEN ISSUED	11,452,714.93	2.85	2,448.00 MONOLITHIC POWER	908,082.68	0.23
16,220.00 ALLIANT ENERGY CORP	877,351.91	0.22	15,762.00 MORGAN STANLEY	1,271,225.05	0.32
862.00 ALPHABET INC -A-	84,163.02	0.02	15,571.00 MOSAIC	768,178.87	0.19
1,413.00 AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	124,691.32	0.03	3,438.00 MSCI INC -A-	1,480,236.84	0.37
49,818.00 AMERICAN EXPRESS	6,860,558.75	1.71	23,154.00 NETAPP	1,461,823.00	0.36
997.00 AMERICAN INTL	48,320.89	0.01	13,004.00 NETFLIX INC	3,125,260.82	0.78
898.00 AMERIPRISE FINANCIAL INC	230,950.95	0.06	2,504.00 NEXTERA ENERGY	200,417.13	0.05
3,084.00 AMPHENOL -A-	210,794.30	0.05	3,236.00 O REILLY AUTO	2,323,320.17	0.58
10,662.00 A.O.SMITH CORP	528,719.40	0.13	3,403.00 ORACLE CORP	212,138.22	0.05
200,657.00 APPLE INC	28,306,841.63	7.03	5,595.00 OTIS WORLDWIDE CORPORATION	364,376.05	0.09
18,146.00 AQUA AMERICA --- REGISTERED SHS	766,479.33	0.19	46,133.00 OWENS CORNING SHS	3,701,847.73	0.92
142,619.00 AT&T INC	2,233,221.52	0.56	3,934.00 PAYCOM SOFTWARE INC	1,325,147.41	0.33
64,700.00 AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	14,938,491.30	3.71	117,597.00 PFIZER INC	5,252,942.09	1.31
52,071.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	14,192,822.35	3.53	13,929.00 PVH CORP	636,981.78	0.16
2,862.00 BLACKROCK INC	1,607,616.35	0.40	82,351.00 QUALCOMM INC	9,497,285.74	2.36
126,908.00 BOSTON SCIENTIF CORP	5,017,247.83	1.25	4,807.00 REGENERON PHARMACEUTICALS INC	3,380,184.85	0.84
6,000.00 CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	564,507.73	0.14	479.00 ROLLINS	16,956.79	0.00
28,586.00 CARRIER GLOBAL CORP-WI	1,037,634.01	0.26	7,031.00 SALESFORCE INC	1,032,347.31	0.26
2,877.00 CHARLES SCHWAB CORP/THE	211,065.17	0.05	26,120.00 SNOWFLAKE INC-CLASS A	4,531,572.70	1.13
28,706.00 CHENIERE ENERGY INC	4,861,544.90	1.21	5.00 SOUTHERN CO	347.06	0.00
4.00 CHIPOTLE MEXICAN GRILL -A-	6,135.91	0.00	7,214.00 SOUTHWEST AIRLINES CO - REGISTERED	227,101.27	0.06
79,150.00 CITIGROUP INC	3,366,692.70	0.84	39,746.00 SYSCO CORP	2,868,820.15	0.71
121,260.00 COCA-COLA CO	6,934,094.01	1.72	712.00 TESLA MOTORS INC	192,781.10	0.05
81,811.00 COLGATE-PALMOLIVE CO	5,866,608.23	1.46	35,521.00 THERMO FISHER SCIENT SHS	18,390,135.24	4.57
2,860.00 CONSOLIDATED EDISON INC	250,368.60	0.06	5,113.00 TRADEWEB MKTS/REGSH	294,467.88	0.07
5,613.00 CONSTELLATION BRANDS INC -A-	1,315,973.91	0.33	83,588.00 TYSON FOODS INC -A-	5,625,434.43	1.40
17,091.00 COPART INC	1,856,257.23	0.46	6,430.00 UDR	273,766.45	0.07
			10.00 UNDER ARMOUR INC -A-	67.88	0.00
			5,474.00 UNION PACIFIC CORP	1,088,597.64	0.27
			184,986.00 VERIZON COMMUNICATIONS INC	7,169,824.35	1.78
			82,089.00 WEC ENERGY GR	7,493,716.40	1.86
			4,731.00 WELLTOWER OP --- REGISTERED SH	310,619.02	0.08

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR	
70,265.00 WESTLAKE --- REGISTERED SHS	6,231,432.86	1.55
3,152.00 WHIRLPOOL CORP	433,747.89	0.11
3,657.00 WW GRAINGER INC	1,826,129.57	0.45
43,760.00 XCEL ENERGY INC	2,858,816.92	0.71
70,241.00 ZOOMINFO TECH --- REGISTERED SHS -A-	2,987,026.04	0.74
Finlande	16,272.34	0.00
2.00 FORTUM CORP	27.54	0.00
1,846.00 NORDEA BK	16,244.80	0.00
France	6,049,596.46	1.50
2,096.00 ACCOR SA	45,294.56	0.01
60,701.00 ENGIE --- REGISTERED LOYALTY BONUS	718,821.24	0.18
65,133.00 ORANGE	602,349.98	0.15
28,384.00 SANOFI	2,225,305.60	0.55
50,913.00 TOTALENERGIESSE	2,457,825.08	0.61
Irlande	4,747,373.24	1.18
9,734.00 ACCENTURE - SHS CLASS A	2,556,584.70	0.64
7,961.00 LINDE PLC	2,190,788.54	0.54
Luxembourg	54,528.08	0.01
2,384.00 SES GLOBAL CERT.GC FID.DEP.REC(1-A-SHS)	13,393.31	0.00
3,101.00 TENARIS SA - REG.SHS	41,134.77	0.01
Panama	57.41	0.00
8.00 CARNIVAL CORP	57.41	0.00
Pays-Bas	17,551,416.13	4.36
194,763.00 AIRBUS SE	17,312,483.07	4.30
152.00 AKZO NOBEL NV	8,864.64	0.00
344.00 DSM KONINKLIJKE	40,402.80	0.01
4,635.00 ING GROUP NV	41,056.83	0.01
931.00 JDE PEET S BV	27,874.14	0.01
94.00 KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	2,456.69	0.00
13,288.00 KONINKLIJKE KPN NV	36,834.34	0.01
946.00 NN GROUP NV	37,811.62	0.01
2,727.00 ROYAL PHILIPS NV	43,632.00	0.01
Royaume-Uni	32,564,431.46	8.09
1,739.00 RELX PLC	43,579.34	0.01
1,202,832.00 SHELL PLC	30,834,598.32	7.66
37,290.00 UNILEVER	1,686,253.80	0.42
Suisse	13,260,802.53	3.30
157.00 BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	304,327.94	0.08
606.00 LONZA GROUP (CHF)	305,639.70	0.08
532.00 NOVARTIS AG REG SHS	41,673.89	0.01
344.00 PARTNERS GROUP HLDG NAMEN AKT	287,059.12	0.07
30,644.00 ROCHE HOLDING LTD	10,279,819.33	2.56
398.00 SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	181,002.90	0.04
26,611.00 TEMENOS AG NAM.AKT	1,861,279.65	0.46
Total portefeuille-titres	455,602,712.99	113.23

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	125,497,127.01	99.76	France	9,279,047.23	7.38
Actions	125,497,127.01	99.76	92,593.00 AXA SA	2,081,027.68	1.65
Allemagne	93,649.24	0.07	5,885.00 L OREAL-ACT REG PROV PRIM.FIDELITE 2013	1,943,521.25	1.54
114.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	871.64	0.00	26,936.00 SANOFI	2,111,782.40	1.69
734.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	92,777.60	0.07	64,871.00 SOCIETE GENERALE SA	1,324,341.47	1.05
Belgique	10,753.86	0.01	37,667.00 TOTALENERGIESSE	1,818,374.43	1.45
221.00 KBC GROUPE SA	10,753.86	0.01	Panama	35.88	0.00
Espagne	5,616,973.28	4.47	5.00 CARNIVAL CORP	35.88	0.00
1,354,007.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	3,246,231.78	2.59	Pays-Bas	5,263,645.18	4.18
22,687.00 FERROVIAL SA	530,648.93	0.42	29.00 AIRBUS SE	2,577.81	0.00
155,874.00 REPSOL SA	1,840,092.57	1.46	593,934.00 ING GROUP NV	5,261,067.37	4.18
Etats-Unis d'Amérique	104,846,663.00	83.34	Royaume-Uni	128.18	0.00
3,776.00 ADOBE INC	1,060,741.29	0.84	5.00 SHELL PLC	128.18	0.00
79,995.00 AMERICAN EXPRESS	11,016,307.30	8.76	Suisse	386,231.16	0.31
33,910.00 APPLE INC	4,783,710.51	3.80	2,055.00 NOVARTIS AG REG SHS	160,977.13	0.13
190,754.00 BANK OF AMERICA CORP	5,880,437.71	4.67	598.00 ROCHE HOLDING LTD	200,604.75	0.16
1,492.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	406,669.57	0.32	987.00 UBS GROUP SA	14,817.29	0.01
15,688.00 BROADRIDGE FINANCIAL SOL -WI	2,311,123.52	1.84	24.00 ZURICH INSURANCE GROUP NAMENSAKT	9,831.99	0.01
17,018.00 CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,601,132.10	1.27	Total portefeuille-titres	125,497,127.01	99.76
3,362.00 CHARLES SCHWAB CORP/THE	246,646.19	0.20			
232,164.00 CITIGROUP INC	9,875,234.91	7.85			
72,407.00 COLGATE-PALMOLIVE CO	5,192,254.12	4.13			
144,278.00 CSX CORP	3,923,407.26	3.12			
111.00 DOW - REGISTERED SHS	4,977.52	0.00			
2.00 DXC TECHNOLOGY	49.98	0.00			
208.00 EDWARDS LIFESCIENCES CORP	17,544.06	0.01			
257.00 ELECTRONIC ARTS - REGISTERED	30,355.20	0.02			
124,151.00 EQUITABLE HOLDINGS INC	3,339,334.30	2.65			
3,414.00 GARTNER INC	964,241.98	0.77			
778.00 GOLDMAN SACHS GROUP INC	232,728.93	0.19			
9,124.00 HERSHEY	2,053,354.03	1.63			
34,328.00 HOME DEPOT INC	9,669,237.30	7.69			
5,000.00 HUMANA INC	2,476,343.59	1.97			
3,502.00 ILLUMINA INC	682,025.81	0.54			
8,620.00 INTEL CORP	226,751.80	0.18			
9,335.00 INTUIT	3,690,738.73	2.93			
49.00 KEYSIGHT TECHNOLOGIES	7,870.81	0.01			
33,877.00 LINCOLN NATIONAL CORP	1,518,439.31	1.21			
849.00 MARKEL CORP	939,624.13	0.75			
1,413.00 MARKETAXESS HOLDING INC	320,908.87	0.26			
27,763.00 META PLATFORMS INC A	3,845,132.28	3.06			
147,863.00 MORGAN STANLEY	11,925,336.22	9.48			
13,183.00 PAYCHEX INC	1,509,992.78	1.20			
9,978.00 PROLOGIS	1,034,823.46	0.82			
9,727.00 PUBLIC STORAGE INC	2,907,326.97	2.31			
93,342.00 REGIONS FINANCIAL CORP	1,912,289.02	1.52			
27,000.00 SALESFORCE INC	3,964,354.62	3.15			
99.00 TWITTER INC	4,430.32	0.00			
10,859.00 ULTA BEAUTY RG REGISTERED	4,447,019.05	3.54			
6.00 UNDER ARMOUR INC -A-	40.73	0.00			
34,843.00 VORNADO REALTY TRUST SHS OF BENEF.INT	823,726.72	0.65			

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	143,299,980.21	101.51	1,368.00 THERMO FISHER SCIENT SHS	708,248.78	0.50
Actions	143,299,980.21	101.51	3.00 UNDER ARMOUR INC -A-	20.36	0.00
			3.00 WASTE MANAGEMENT	490.61	0.00
			1,956.00 WW GRAINGER INC	976,732.14	0.69
Allemagne	30,389,620.64	21.53	Finlande	10,124,745.16	7.17
19,728.00 ALLIANZ SE REG SHS	3,191,990.40	2.26	73,406.00 SAMPO OYJ -A-	3,212,246.56	2.28
89,427.00 BAYER AG REG SHS	4,240,181.21	3.00	212,170.00 UPM KYMMENE CORP	6,912,498.60	4.89
527,568.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	4,033,784.93	2.86	France	5,043,644.05	3.57
70,193.00 FRESENIUS SE	1,540,736.35	1.09	100,000.00 ENGIE --- REGISTERED LOYALTY BONUS	1,184,200.00	0.84
3,159.00 PORSCHE AUTOMOBIL HLDG - VORZ.AKT-STIMMR	183,727.44	0.13	2,773.00 L OREAL-ACT REG PROV PRIM.FIDELITE 2013	915,783.25	0.65
349,554.00 RWE AG	13,209,645.66	9.37	2,603.00 LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	1,588,871.20	1.12
216,317.00 SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	2,462,769.05	1.74	28,064.00 TOTALENERGIESSE	1,354,789.60	0.96
12,079.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	1,526,785.60	1.08	Irlande	3,201,476.71	2.27
Autriche	1,379,049.09	0.98	3,291.00 ACCENTURE - SHS CLASS A	864,364.11	0.61
2,922.00 AMS-OSRAM AG	18,928.45	0.01	1,182.00 ALLEGION PLC WI	108,203.71	0.08
60,076.00 ERSTE GROUP BANK AG	1,360,120.64	0.97	8,051.00 LINDE PLC	2,215,555.65	1.57
Belgique	238,754.88	0.17	162.00 MEDTRONIC HLD	13,353.24	0.01
6,377.00 AGEAS NOM	238,754.88	0.17	Luxembourg	103,775.70	0.07
Espagne	20,034,151.37	14.19	18,472.00 SES GLOBAL CERT.GC FID.DEP.REC(1-A-SHS)	103,775.70	0.07
29,545.00 AMADEUS IT GROUP SA -A-	1,415,500.95	1.00	Norvège	1,899,463.25	1.35
152,203.00 ENDESA	2,346,970.26	1.66	52,903.00 YARA INTERNATIONAL ASA	1,899,463.25	1.35
369,540.00 RED ELECTRICA	5,805,473.40	4.11	Panama	14.35	0.00
886,591.00 REPSOL SA	10,466,206.76	7.42	2.00 CARNIVAL CORP	14.35	0.00
Etats-Unis d'Amérique	23,008,819.08	16.30	Pays-Bas	40,674,673.73	28.81
1,015.00 ADOBE INC	285,130.40	0.20	546,189.00 AEGON NV	2,240,467.28	1.59
14,480.00 ALPHABET INC -C-	1,421,172.87	1.01	44,741.00 AIRBUS SE	3,977,027.49	2.82
10,200.00 AMEREN CORPORATION	838,677.08	0.59	33.00 ASM INTERNATIONAL NV	7,713.75	0.01
7,340.00 AMERICAN INTL	355,742.56	0.25	6,026.00 DSM KONINKLIJKE	707,753.70	0.50
11,063.00 APPLE INC	1,560,666.16	1.11	1,935.00 FERRARI NV	370,939.50	0.26
2,650.00 BECTON DICKINSON	602,765.78	0.43	41,000.00 HEINEKEN NV	3,684,260.00	2.61
1,502.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	409,395.23	0.29	878,192.00 ING GROUP NV	7,779,024.74	5.51
4,421.00 BOSTON SCIENTIF CORP	174,782.15	0.12	90,579.00 JDE PEET S BV	2,711,935.26	1.92
3,107.00 CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	305,260.81	0.22	38,572.00 KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	1,008,079.22	0.71
3,245.00 CHEVRON CORP	475,893.58	0.34	1,669.00 LYONDELLBASELL -A-	128,252.25	0.09
2,426.00 COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS -A-	142,244.11	0.10	450,037.00 ROYAL PHILIPS NV	7,200,592.00	5.10
309.00 COSTCO WHOLESALE CORP	148,962.82	0.11	358,732.00 STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	4,403,794.03	3.12
3,636.00 COTERRA ENERGY INC	96,945.15	0.07	444,071.00 STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	5,449,639.31	3.86
1.00 DXC TECHNOLOGY	24.99	0.00	10,060.00 WOLTERS KLUWER NV	1,005,195.20	0.71
1,290.00 ELEVANCE HEALTH	598,141.79	0.42	Portugal	3,897,507.48	2.76
4,635.00 ELI LILLY & CO	1,529,859.90	1.08	877,817.00 EDP-ENERGIAS DE PORTUGAL SA - REG.SHS	3,897,507.48	2.76
64,639.00 FREEPORT MCMORAN COPPER AND GOLD INC	1,803,280.63	1.28	Royaume-Uni	1,006,745.99	0.71
2,349.00 HEALTHPEAK PROPERTIES INC	54,957.46	0.04	20,671.00 SHELL PLC	529,901.09	0.37
40,701.00 INTEL CORP	1,070,652.55	0.76	10,545.00 UNILEVER	476,844.90	0.34
6,515.00 IROBOT	374,613.33	0.27	Suisse	2,297,538.73	1.63
4,759.00 KEYSIGHT TECHNOLOGIES	764,432.44	0.54	348.00 BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	674,561.29	0.47
10,438.00 KIMBERLY-CLARK CORP	1,199,094.08	0.85	1.00 DUFREY GROUP	31.50	0.00
2,899.00 LAM RESEARCH CORP	1,083,074.57	0.77	662.00 HELVETIA HLDG - REGISTERED SHS	63,783.24	0.05
15,886.00 META PLATFORMS INC A	2,200,186.27	1.56	3,985.00 NESTLE SA REG SHS	442,557.35	0.31
2,224.00 MICROSOFT CORP	528,729.24	0.37	7,891.00 NOVARTIS AG REG SHS	618,136.52	0.44
1,858.00 O REILLY AUTO	1,333,970.60	0.94	1,244.00 ROCHE HOLDING LTD	417,311.55	0.30
2,544.00 ORACLE CORP	158,589.37	0.11			
8,445.00 PAYPAL HOLDINGS	741,960.04	0.53			
182.00 QUALCOMM INC	20,989.50	0.01			
15,028.00 SOUTHERN CO	1,043,131.73	0.74			

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
5,406.00 UBS GROUP SA	EUR 81,157.28	0.06
Total portefeuille-titres	143,299,980.21	101.51

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	6,379,914,970.95	100.75	140,064.00 APPLIED MATERIALS INC	11,713,819.75	0.18
Actions	6,379,914,970.95	100.75	23,215.00 ARISTA NETWORKS INC	2,675,181.29	0.04
Allemagne	84,784,484.68	1.34	25,682.00 ARTHUR J.GALLAGHER AN CO	4,488,615.36	0.07
213,273.00 ALLIANZ SE REG SHS	34,507,571.40	0.55	20.00 AUTODESK INC	3,813.61	0.00
360,789.00 BAYER AG REG SHS	17,106,810.44	0.27	74,338.00 AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	17,163,795.46	0.27
2,266,059.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	17,326,287.11	0.27	5,082.00 AUTOZONE INC	11,111,405.36	0.18
13,804.00 FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	400,730.12	0.01	47,015.00 AVERY DENNISON CORP	7,808,238.15	0.12
15,862.00 NEMETSCHKE	780,886.26	0.01	67,491.00 BANK OF AMERICA CORP	2,080,567.75	0.03
25,467.00 PORSCHE AUTOMOBIL HLDG - VORZ.AKT-STIMMR	1,481,160.72	0.02	348,920.00 BANK OF NY MELLON	13,719,592.10	0.22
348,797.00 RWE AG	13,181,038.63	0.21	130,105.00 BAXTER INTERNATIONAL INC	7,153,019.24	0.11
Autriche	11,074,167.92	0.17	43,303.00 BECTON DICKINSON	9,849,647.82	0.16
700,304.00 AMS-OSRAM AG	4,536,505.68	0.07	39,920.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	10,880,863.98	0.17
288,766.00 ERSTE GROUP BANK AG	6,537,662.24	0.10	703.00 BIO RAD LABORATORIES -A-	299,341.01	0.00
Belgique	10,989,254.96	0.17	114,042.00 BIOGEN IDEC INC	31,081,727.15	0.49
26,330.00 AGEAS NOM	985,795.20	0.02	24,694.00 BLACKROCK INC	13,870,886.87	0.22
76,567.00 COFINIMMO SA	6,492,881.60	0.10	80,227.00 BORGWARNER INC	2,571,456.95	0.04
11,834.00 GROUPE BRUXELLES LAMBERT GBL	850,627.92	0.01	631,263.00 BOSTON SCIENTIF CORP	24,956,684.52	0.39
54,664.00 KBC GROUPE SA	2,659,950.24	0.04	53,121.00 BROADCOM INC - REGISTERED SHS	24,076,206.00	0.38
Bermudes	4,314,998.17	0.07	2,286.00 BROADRIDGE FINANCIAL SOL -W/I	336,768.76	0.01
3,566.00 EVEREST REINSURANCE GROUP	955,301.42	0.02	7,966.00 BROWN AND BROWN INC	491,791.64	0.01
199,482.00 INVESCO LTD	2,789,673.25	0.04	296,347.00 BROWN-FORMAN CORP -B- NON VOTING	20,137,620.36	0.32
49,157.00 NORVERGIAN CRUISE LINE LTD	570,023.50	0.01	154,715.00 CADENCE DESIGN SYSTEMS INC	25,810,312.31	0.41
Espagne	75,169,211.40	1.19	29,042.00 CAMDEN PROPERTY SBI	3,541,128.87	0.06
197,776.00 AMADEUS IT GROUP SA -A-	9,475,448.16	0.15	236,188.00 CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	22,221,658.71	0.35
27,400,944.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	65,693,763.24	1.04	787,099.00 CARDINAL HEALTH	53,573,992.06	0.85
Etats-Unis d'Amérique	4,408,708,669.72	69.63	3,573.00 CARMAX INC	240,789.53	0.00
476,210.00 ABBOTT LABORATORIES	47,035,246.87	0.74	45,608.00 CATERPILLAR - REGISTERED	7,638,810.43	0.12
307,976.00 ABBVIE INC	42,192,067.53	0.67	65,457.00 CDW	10,428,753.70	0.16
16,124.00 ABIOMED INC	4,043,303.06	0.06	51,039.00 CENTENE CORP	4,053,840.24	0.06
169,334.00 ADOBE INC	47,568,740.67	0.75	321,776.00 CENTERPOINT ENERGY	9,256,007.43	0.15
104,611.00 ADVANCED MICRO DEVICES INC	6,765,837.76	0.11	55,956.00 CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	5,497,642.02	0.09
80,801.00 AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	19,195,444.02	0.30	826.00 CHARLES SCHWAB CORP/THE	60,597.78	0.00
3,707.00 AKAMAI TECHNOLOGIES	303,931.24	0.00	276,561.00 CHEVRON CORP	40,558,892.33	0.64
4,737.00 ALIGN TECHNOLOGY INC	1,001,459.78	0.02	171,298.00 CHURCH AND DWIGHT CO	12,491,735.95	0.20
503,672.00 ALLIANT ENERGY CORP	27,243,994.57	0.43	49,559.00 CIGNA CORPORATION - REGISTERED SHS	14,036,784.29	0.22
36,058.00 ALLSTATE CORP	4,583,578.56	0.07	78,605.00 CINCINNATI FINANCIAL CORP	7,186,903.33	0.11
145,221.00 AMERICAN WATER WORKS CO INC	19,294,610.69	0.30	934,833.00 CITIGROUP INC	39,763,682.04	0.63
2,270.00 AMEREN CORPORATION	186,646.76	0.00	7,223.00 CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	253,337.70	0.00
6,594.00 AMERICAN AIRLINES GROUP INC-REGS	81,040.94	0.00	36,000.00 CLOROX CO	4,718,052.37	0.07
500,310.00 AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	44,150,257.23	0.70	57,662.00 CMS ENERGY CORP	3,427,994.57	0.05
774,321.00 AMERICAN INTL	37,528,465.35	0.59	132,471.00 COCA-COLA CO	7,575,180.34	0.12
25,268.00 AMERIPRISE FINANCIAL INC	6,498,517.43	0.10	34,695.00 COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS -A-	2,034,278.36	0.03
94,292.00 AMERISOURCEBERGEN CORP	13,025,607.47	0.21	6,992.00 COMERICA INC	507,457.97	0.01
199,967.00 AMETEK INC	23,149,346.67	0.37	7,321.00 CONAGRA BRANDS INC	243,846.51	0.00
365,201.00 AMGEN INC	84,026,239.37	1.33	53,041.00 CONSOLIDATED EDISON INC	4,643,287.05	0.07
266,838.00 AMPHENOL -A-	18,238,628.57	0.29	264,440.00 CONSTELLATION BRANDS INC -A-	61,998,243.45	0.98
141,367.00 ANALOG DEVICES INC	20,107,260.53	0.32	32,146.00 CONSTELLATION ENERGY	2,729,776.70	0.04
17,707.00 ANSYS INC	4,007,188.18	0.06	6,289.00 COOPER COMPANIES INC	1,694,142.91	0.03
96,638.00 A.O.SMITH CORP	4,792,195.21	0.08	25,321.00 COPART INC	2,750,119.33	0.04
65,945.00 APA - REGISTERED SHS	2,301,494.97	0.04	229,143.00 CORNING INC	6,787,862.87	0.11
1,056,412.00 APPLE INC	149,028,876.03	2.35	178,313.00 CORTEVA - REGISTERED SHS	10,402,274.23	0.16
			75,890.00 COSTCO WHOLESALE CORP	36,585,076.61	0.58
			66,726.00 COTERRA ENERGY INC	1,779,087.55	0.03
			73,987.00 CROWN CASTLE INC	10,916,981.42	0.17
			491.00 CUMMINS - REGISTERED	101,999.09	0.00
			132,331.00 CVS HEALTH	12,882,567.72	0.20
			45,498.00 DARDEN RESTAURANTS INC	5,866,694.60	0.09

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets		
EUR			EUR				
456.00	DAVITA	38,527.15	0.00	262,020.00	HEALTHPEAK PROPERTIES INC	6,130,248.97	0.10
620,100.00	DELTA AIR LINES	17,761,451.54	0.28	63,300.00	HENRY JACK AND ASSOCIATES INC	11,777,360.28	0.19
35,901.00	DENTSPLY SIRONA INC	1,038,935.69	0.02	38,859.00	HOLOGIC INC	2,559,263.70	0.04
10,852.00	DEXCOM INC	892,175.86	0.01	116,814.00	HOME DEPOT INC	32,903,236.01	0.52
4,075.00	DIAMONDBACK ENERGY	501,071.30	0.01	252,956.00	HONEYWELL INTERNATIONAL INC	43,113,421.45	0.68
220,784.00	DISCOVER FINANCIAL SERVICES - SHS WI	20,490,666.34	0.32	208,274.00	HORMEL FOODS CORP	9,660,563.02	0.15
2,894.00	DISH NETWORK -A-	40,855.43	0.00	418,187.00	HP ENTERPRISE CO	5,113,949.12	0.08
85,204.00	DOMINION RESOURCES - REGSITERED	6,010,767.56	0.09	98,523.00	HP INC	2,506,194.21	0.04
23,105.00	DOMINO PIZZA INC	7,316,052.67	0.12	204,694.00	HUMANA INC	101,378,535.05	1.60
2,004.00	DOVER CORP	238,479.38	0.00	126,773.00	HUNTINGTON BANCSHARES INC	1,705,576.62	0.03
221,470.00	DOW - REGISTERED SHS	9,931,278.62	0.16	9,448.00	HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIESINC	2,136,203.75	0.03
238,615.00	DOWDUPONT - REGISTERED SHS WI	12,276,012.86	0.19	20,420.00	IDEX CORP	4,165,709.18	0.07
118,147.00	DTE ENERGY COMPANY	13,875,172.10	0.22	98,924.00	ILLINOIS TOOL WORKS	18,241,842.09	0.29
199,723.00	DUKE ENERGY CORP	18,964,153.99	0.30	108,129.00	ILLUMINA INC	21,058,471.81	0.33
183,835.00	DXC TECHNOLOGY	4,593,763.90	0.07	238,968.00	INCYTE CORP	16,255,629.58	0.26
10,746.00	EASTMAN CHEMICAL CO	779,363.34	0.01	534,105.00	INTEL CORP	14,049,799.27	0.22
36,268.00	EBAY INC	1,362,757.19	0.02	447,259.00	INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	41,249,273.36	0.65
121,197.00	EDWARDS LIFESCIENCES CORP	10,222,536.73	0.16	70,331.00	INTERNATIONAL PAPER CO	2,275,805.34	0.04
6,034.00	ELECTRONIC ARTS - REGISTERED	712,697.53	0.01	121,458.00	INTERPUBLIC GROUP OF COMPANIES INC	3,173,913.95	0.05
40,073.00	ELEVANCE HEALTH	18,580,880.44	0.29	60,686.00	INTUITIVE SURGICAL	11,611,273.25	0.18
88,022.00	ELI LILLY & CO	29,053,145.20	0.46	2,809.00	IQVIA HOLDINGS INC	519,391.88	0.01
163,850.00	EMERSON ELECTRIC CO	12,246,309.40	0.19	9,142.00	J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	1,459,696.46	0.02
21,367.00	ENPHASE ENERGY	6,051,856.78	0.10	3,756.00	J.M. SMUCKER CO SHS	526,833.01	0.01
255,753.00	ENTERGY CORP	26,271,040.06	0.41	808,611.00	JOHNSON & JOHNSON	134,838,659.68	2.13
17,142.00	EOG RESOURCES INC	1,955,061.15	0.03	145,403.00	JUNIPER NETWORKS INC	3,876,819.64	0.06
831.00	EPAM SYSTEMS	307,232.06	0.00	20,525.00	KELLOGG CO	1,459,471.75	0.02
153,828.00	EQTY RESIDENTIAL PPTYS TR SHS BEN.INT.	10,555,114.75	0.17	215,849.00	KEYCORP	3,529,731.01	0.06
25,608.00	EQUINIX INC	14,869,447.99	0.23	11,324.00	KEYSIGHT TECHNOLOGIES	1,818,960.49	0.03
142,377.00	ESSEX PROPERTY TRUST	35,204,390.05	0.56	62,890.00	KIMBERLY-CLARK CORP	7,224,662.48	0.11
133,674.00	ESTEE LAUDER COMPANIES INC -A-	29,459,721.94	0.47	107,006.00	KINDER MORGAN INC	1,817,567.34	0.03
215,130.00	EVERGY	13,044,170.88	0.21	3,101.00	KLA CORPORATION	957,949.91	0.02
105,571.00	EVERSOURCE ENERGY	8,401,281.23	0.13	33,430.00	KROGER CO	1,492,943.91	0.02
229,386.00	EXPEDIA GROUP INC	21,937,604.59	0.35	23,938.00	LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS	5,004,585.09	0.08
35,370.00	EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON	3,188,408.82	0.05	39,694.00	LAM RESEARCH CORP	14,829,790.23	0.23
26,343.00	EXTRA SPACE STORAGE INC	4,644,209.19	0.07	11,304.00	LAS VEGAS SANDS CORP	432,936.33	0.01
1,167,458.00	EXXON MOBIL CORP	104,048,137.58	1.64	178,047.00	LEIDOS HOLDINGS INC	15,897,280.75	0.25
1,000.00	FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	408,421.37	0.01	154,179.00	LENNAR CORP -A-	11,732,807.07	0.19
25,496.00	FASTENAL CO	1,198,219.61	0.02	505,342.00	LINCOLN NATIONAL CORP	22,650,505.00	0.36
302,230.00	FEDEX CORP	45,804,203.64	0.72	191,886.00	LOEWS CORP	9,762,260.24	0.15
48,002.00	FIDELITY NATIONAL INFO SERVICES INC	3,702,864.43	0.06	22,285.00	LOWE'S CO INC	4,272,286.89	0.07
44,263.00	FIRST REPUBLIC BANK	5,898,570.56	0.09	613,561.00	MARATHON OIL CORP	14,141,997.02	0.22
1,276,487.00	FIRSTENERGY CORP	48,211,115.19	0.76	91,822.00	MARATHON PETROLEUM	9,310,140.62	0.15
124,541.00	FMC CORP	13,437,435.51	0.21	26,127.00	MARKETAXESS HOLDING INC	5,933,748.00	0.09
123,237.00	FORTUNE BRANDS	6,754,039.23	0.11	71,675.00	MARSH MCLENNAN COS	10,922,636.40	0.17
237,272.00	FOX CORP -A-	7,430,720.11	0.12	17,831.00	MARTIN MARIETTA	5,862,488.43	0.09
16,082.00	FOX CORP -B-	467,857.91	0.01	9,016.00	MASCO CORP	429,701.46	0.01
332,574.00	FREEMPORT MCMORAN COPPER AND GOLD INC	9,278,055.86	0.15	93,416.00	MCDONALD'S CORP	22,002,559.93	0.35
937.00	GARTNER INC	264,644.04	0.00	253,302.00	MERCK & CO INC	22,267,512.11	0.35
68,429.00	GENERAL ELECTRI	4,324,441.78	0.07	227,048.00	META PLATFORMS INC A	31,445,794.56	0.50
110,885.00	GENERAL MILLS INC	8,671,362.07	0.14	6,084.00	METLIFE INC	377,466.97	0.01
4,308.00	GENUINE PARTS CO	656,633.04	0.01	3,538.00	METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	3,915,292.77	0.06
521,557.00	GILEAD SCIENCES INC	32,843,210.67	0.52	558,040.00	MGM RESORTS INTL	16,929,463.38	0.27
8,717.00	GLOBAL PAYMENTS INC	961,437.09	0.02	18,785.00	MICROCHIP TECHNOLOGY	1,170,263.41	0.02
4,868.00	GLOBE LIFE INC	495,421.43	0.01	11,503.00	MICROSOFT CORP	2,734,699.84	0.04
52,318.00	GOLDMAN SACHS GROUP INC	15,650,272.95	0.25	157,560.00	MID-AMER APARTMENT COMMUNITIES INC	24,940,365.64	0.39
3,971.00	HASBRO INC	273,286.19	0.00	34,784.00	MOHAWK INDUSTRIES INC	3,237,843.07	0.05
32,164.00	HCA INC	6,034,217.89	0.10	10,176.00	MOLINA HEALTHCARE	3,426,174.49	0.05

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets		
	EUR			EUR			
86,977.00	MONOLITHIC POWER	32,264,014.49	0.51	289,954.00	SEMPRA ENERGY	44,378,811.58	0.70
3,871.00	MONSTER BEVERAGE CORP	343,614.72	0.01	61,696.00	SERVICENOW INC	23,780,969.28	0.38
29,468.00	MOODY S CORP	7,312,780.56	0.12	56,303.00	SHERWIN WILLIAMS CO	11,767,508.04	0.19
384,999.00	MORGAN STANLEY	31,050,651.75	0.49	88,981.00	SIMON PROPERTY GROUP - REGISTERED	8,151,936.66	0.13
39,023.00	MOSAIC	1,925,158.57	0.03	90,284.00	SKYWORKS SOLUTIONS INC	7,858,435.85	0.12
24,634.00	MSCI INC -A-	10,606,211.26	0.17	583.00	SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	137,744.28	0.00
31,466.00	NASDAQ INC	1,820,540.89	0.03	50,212.00	SOUTHERN CO	3,485,342.72	0.06
46,045.00	NETAPP	2,907,041.55	0.05	275,955.00	SOUTHWEST AIRLINES CO - REGISTERED	8,687,237.48	0.14
3,927.00	NEWELL BRANDS	55,679.10	0.00	162,068.00	S&P GLOBAL INC	50,515,453.27	0.80
652,904.00	NEWMONT CORPORATION	28,011,591.00	0.44	61,825.00	STRYKER CORP	12,782,152.30	0.20
205,098.00	NEXTERA ENERGY	16,415,795.62	0.26	5,416.00	SVB FINANCIAL GROUP	1,856,361.44	0.03
237,142.00	NIKE INC	20,120,699.27	0.32	7,648.00	SYNCHRONY FINANCIAL	220,075.66	0.00
309,684.00	NISOURCE	7,962,986.74	0.13	1,268.00	SYNOPSYS	395,433.76	0.01
847.00	NORDSON	183,527.47	0.00	46,129.00	SYSCO CORP	3,329,537.68	0.05
52,914.00	NORFOLK SOUTHERN	11,323,860.66	0.18	312,338.00	TAPESTRY INC	9,064,226.35	0.14
134,189.00	NORTHERN TRUST CORP	11,719,706.87	0.19	697.00	TELEDYNE TECHNOLOGIES	240,102.68	0.00
512,702.00	NVIDIA CORP	63,529,725.70	1.00	14,309.00	TELEFLEX INC	2,942,572.49	0.05
1,031.00	NVR INC	4,196,069.49	0.07	18,224.00	TERADYNE INC	1,397,982.54	0.02
1,583.00	O REILLY AUTO	1,136,531.47	0.02	134,873.00	TESLA MOTORS INC	36,518,208.80	0.58
311,259.00	OMNICOM GROUP INC	20,045,251.17	0.32	61,483.00	TEXAS INSTRUMENTS INC	9,714,019.03	0.15
48,570.00	ONEOK INC (NEW)	2,540,424.44	0.04	400,963.00	THE HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP	25,351,552.31	0.40
51,944.00	ORGANON --- REGISTERED SHS	1,240,738.63	0.02	511,103.00	THE KRAFT HEINZ	17,399,362.07	0.27
73,062.00	OTIS WORLDWIDE CORPORATION	4,758,184.66	0.08	288,358.00	THERMO FISHER SCIENT SHS	149,290,352.70	2.37
3,468.00	PACKAGING CORP OF AMERICA	397,511.07	0.01	11,089.00	TRACTOR SUPPLY CO	2,104,040.55	0.03
92,368.00	PARKER-HANNIFIN CORP	22,846,618.77	0.36	96,012.00	TRAVELERS COS INC/THE	15,014,585.21	0.24
19,906.00	PAYCHEX INC	2,280,051.30	0.04	41,297.00	TRIMBLE	2,287,743.78	0.04
4,376.00	PAYCOM SOFTWARE INC	1,474,032.81	0.02	605,916.00	TWITTER INC	27,115,150.76	0.43
50,682.00	PENN ENTERTAINMENT INC	1,423,224.44	0.02	75,415.00	TYSON FOODS INC -A-	5,075,395.24	0.08
16,055.00	PEPSICO INC	2,675,587.51	0.04	268,868.00	UDR	11,447,439.68	0.18
10,872.00	PERKINELMER	1,335,403.22	0.02	108,568.00	ULTA BEAUTY RG REGISTERED	44,461,180.95	0.70
1,001,162.00	PFIZER INC	44,720,919.84	0.71	93,523.00	UNDER ARMOUR INC -A-	634,847.09	0.01
58,792.00	PHILLIPS 66	4,844,271.16	0.08	160,104.00	UNION PACIFIC CORP	31,839,392.93	0.50
3,449.00	PINNACLE WEST CAPITAL CORP	227,116.82	0.00	54,177.00	UNITED AIRLINES HOLDINGS INC	1,798,987.20	0.03
233,439.00	PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC	35,605,017.49	0.56	144,778.00	UNITEDHEALTH GROUP INC	74,637,555.37	1.18
629,492.00	PPL CORP	16,289,105.50	0.26	347,945.00	VALERO ENERGY CORP	37,950,210.02	0.60
776,015.00	PROCTER & GAMBLE CO	100,007,036.95	1.58	21,939.00	VERISIGN INC	3,889,965.09	0.06
60,916.00	PROGRESSIVE CORP	7,226,099.48	0.11	207,901.00	VERIZON COMMUNICATIONS INC	8,057,980.88	0.13
69,532.00	PROLOGIS	7,211,199.10	0.11	42,184.00	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	12,467,672.50	0.20
33,834.00	PTC INC	3,612,551.83	0.06	41,036.00	VF REGISTERED	1,252,882.93	0.02
72,302.00	PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC	4,149,993.83	0.07	336,270.00	VIATRIS INC - REGISTERED SHS	2,924,534.68	0.05
58,369.00	PUBLIC STORAGE INC	17,446,054.09	0.28	50,843.00	VISA INC -A-	9,219,883.58	0.15
33,462.00	QORVO INC	2,712,415.07	0.04	13,963.00	VORNADO REALTY TRUST SHS OF BENEF.INT	330,100.63	0.01
434,191.00	QUALCOMM INC	50,073,903.11	0.79	45,790.00	VULCAN MATERIALS CO	7,371,551.98	0.12
2,325.00	QUANTA SERVICES - REGISTERED	302,334.25	0.00	10,504.00	WABTEC CORP	872,250.70	0.01
64,632.00	RALPH LAUREN CORP -A-	5,603,221.31	0.09	182,882.00	WALMART INC	24,212,520.19	0.38
294,483.00	RAYTHEON TECHNOLOGIES CORPORATION	24,607,133.55	0.39	106,369.00	WASTE MANAGEMENT	17,395,373.34	0.27
24,678.00	REGENCY CENTERS	1,356,515.39	0.02	11,554.00	WATERS	3,178,838.99	0.05
8,761.00	REGENERON PHARMACEUTICALS INC	6,160,557.41	0.10	705,809.00	WELLS FARGO AND CO	28,977,326.58	0.46
293,813.00	REGIONS FINANCIAL CORP	6,019,320.07	0.10	7,966.00	WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC	2,000,993.50	0.03
78,709.00	REPUBLIC SERVICES -A-	10,929,997.82	0.17	37,422.00	WESTERN DIGITAL CORP	1,243,389.07	0.02
32,092.00	RESMED	7,151,210.74	0.11	109,627.00	WESTROCK	3,456,722.33	0.05
9,043.00	ROCKWELL AUTOMATION	1,985,647.66	0.03	75,431.00	WEYERHAEUSER CO	2,199,060.24	0.03
24,080.00	ROLLINS	852,441.59	0.01	8,352.00	WHIRLPOOL CORP	1,149,321.82	0.02
179,965.00	SALESFORCE INC	26,423,891.00	0.42	246,001.00	WILLIAMS COS INC	7,189,311.11	0.11
70,903.00	SBA COMMUNICATIONS -A	20,601,785.28	0.33	13,074.00	W.R.BERKLEY CORP	861,857.72	0.01
81,055.00	SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	4,404,182.77	0.07	17,762.00	WW GRAINGER INC	8,869,486.84	0.14
253,435.00	SEALED AIR	11,514,716.33	0.18	1,456.00	WYNN RESORTS LTD	93,678.03	0.00

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets		
	EUR			EUR			
341,253.00	XCEL ENERGY INC	22,293,872.30	0.35	152,300.00	KUBOTA CORP	2,152,401.21	0.03
48,539.00	XYLEM INC	4,328,451.02	0.07	51,600.00	LASERTEC CORP	5,347,427.42	0.08
35,339.00	YUM BRANDS INC	3,836,012.11	0.06	143,700.00	MONOTARO CO LTD	2,251,782.45	0.04
37,083.00	ZEBRA TECHNOLOGIES -A-	9,917,947.05	0.16	675,400.00	ODAKYU ELECTRIC RAILWAY CO LTD	8,878,356.33	0.14
621.00	ZIMMER BIOMET HLDGS SHS	66,274.23	0.00	45,600.00	SHIMANO INC	7,312,753.09	0.12
65,310.00	ZIONS BANCORPORATION NA	3,390,666.67	0.05	157,400.00	TECMO KOEI HOLDINGS	2,636,294.65	0.04
281,300.00	ZOETIS INC -A-	42,580,489.97	0.67	44,000.00	TREND MICRO INC	2,426,526.49	0.04
217,872.00	3M CO	24,574,956.36	0.39		Libéria	700,007.76	0.01
	Finlande	4,369,449.68	0.07	18,094.00	ROYAL CARIBBEAN CRUISES	700,007.76	0.01
34,947.00	KESKO CORP	669,060.32	0.01		Panama	2,620,069.84	0.04
84,561.00	SAMPO OYJ -A-	3,700,389.36	0.06	365,114.00	CARNIVAL CORP	2,620,069.84	0.04
	France	472,176,679.68	7.46		Pays-Bas	257,331,754.85	4.06
92,258.00	ACCOR SA	1,993,695.38	0.03	474,710.00	AIRBUS SE	42,196,971.90	0.67
561,623.00	AIR LIQUIDE NOM. PRIME FIDELITE	66,024,399.88	1.04	149,349.00	AKZO NOBEL NV	8,710,033.68	0.14
3,250,000.00	AXA SA	73,043,750.00	1.15	53,990.00	ASML HOLDING NV	23,410,064.00	0.37
1,038,509.00	CIE DE SAINT-GOBAIN	38,476,758.45	0.61	3,675,037.00	ING GROUP NV	32,553,477.75	0.51
395,607.00	ENGIE --- REGISTERED LOYALTY BONUS	4,684,778.09	0.07	201,206.00	LYONDELLBASELL -A-	15,461,427.73	0.24
299,746.00	ESSILORLUXOTTICA SA	42,069,351.10	0.66	40,127.00	NXP SEMICONDUCTORS	6,042,090.31	0.10
37,273.00	KERING	17,091,534.15	0.27	2,736,972.00	ROYAL PHILIPS NV	43,791,552.00	0.69
79,661.00	L OREAL-ACT REG PROV PRIM.FIDELITE 2013	26,308,045.25	0.42	5,756.00	SIGNIFY NV	153,282.28	0.00
35,085.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	21,415,884.00	0.34	2,990,662.00	STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	36,701,404.06	0.58
424,495.00	ORANGE	3,925,729.76	0.06	60,845.00	STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	746,933.22	0.01
760,101.00	SANOFI	59,591,918.40	0.94	476,026.00	WOLTERS KLUWER NV	47,564,517.92	0.75
282,941.00	SCHNEIDER ELECTRIC SE	33,087,120.54	0.52		Royaume-Uni	17,270,031.05	0.27
1,729,888.00	TOTALENERGIESE	83,510,343.20	1.33	673,686.00	SHELL PLC	17,269,940.61	0.27
119,590.00	VIVENDI SA	953,371.48	0.02	2.00	UNILEVER	90.44	0.00
	FR-Curacao	207,891.29	0.00		Suède	32,029,273.19	0.51
5,673.00	SCHLUMBERGER LTD	207,891.29	0.00	25,000.00	CASTELLUM AB	287,789.80	0.00
	Ile de Jersey	341,931.74	0.01	268,000.00	EPIROC --- REGISTERED SHS -A-	3,947,901.19	0.05
4,283.00	APTIV PLC	341,931.74	0.01	123,000.00	EQT AB	2,478,860.15	0.04
	Irlande	223,835,095.97	3.53	156,000.00	FABEGE -REGISTERED SHS	1,089,107.91	0.02
199,977.00	ACCENTURE - SHS CLASS A	52,522,923.60	0.82	318,000.00	FASTIGHETS-B SHS SHARES	1,309,101.19	0.02
19,369.00	ALLEGION PLC WI	1,773,094.39	0.03	58,000.00	GETINGE -B-	1,022,715.04	0.02
82,277.00	AON - REGISTERED SHS (USD)	22,497,361.29	0.36	114,000.00	HEXPOL -B-	963,662.37	0.02
14,854.00	EATON CORPORATION PUBLIC LIMITED COMPANYY	2,022,078.74	0.03	19,000.00	HOLMEN-REGISTERED SHS	741,883.71	0.01
20,958.00	JOHNSON CONTROLS INTL	1,052,980.92	0.02	227,000.00	HUSQVARNA -B-	1,296,647.70	0.02
479,963.00	LINDE PLC	132,081,075.05	2.08	116,000.00	INDUSTRIVAERDEN AB -A- FREE	2,408,208.51	0.04
86,470.00	PENTAIR PLC	3,586,256.42	0.06	2,000.00	INDUTRADE AB	33,555.16	0.00
40,462.00	WILLIS TOWERS WATSON PLC	8,299,325.56	0.13	144,000.00	INVESTOR --- REGISTERED SHS -A-	2,272,258.58	0.04
	Italie	119,016,800.00	1.88	187,000.00	KINNEVIK AB	2,538,823.45	0.04
4,900,000.00	ENI SPA	53,459,000.00	0.84	37,000.00	LATOUR INVESTMENT REGISTERED B	631,661.25	0.01
38,500,000.00	INTESA SANPAOLO	65,557,800.00	1.04	46,000.00	LIFCO AB	660,911.64	0.01
	Japon	270,381,330.47	4.27	33,000.00	LUNDBERGFOERETAGEN -B- FREE	1,227,522.96	0.02
1,814,800.00	DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC	29,333,844.85	0.46	138,000.00	SAGAX -B-	2,338,154.74	0.04
12,300.00	FAST RETAILING CO LTD	6,653,998.54	0.11	133,000.00	SINCH	184,189.89	0.00
84,100.00	HOSHIZAKI	2,393,123.67	0.04	241,000.00	SKANSKA -B- FREE	3,092,400.88	0.05
55,000.00	ITO EN LTD	2,272,929.22	0.04	558,000.00	TELIA COMPANY AB	1,643,976.77	0.03
7,436,900.00	JAPAN POST HOLDINGS CO	50,228,133.05	0.79	48,000.00	TRELLEBORG -B- FREE	926,740.65	0.01
400,100.00	KEYENCE CORP	135,154,239.02	2.13	94,000.00	WALLENSTAM BYGGNADS AB	350,868.54	0.01
223,700.00	KINTETSU HLDG SHS	7,603,939.09	0.12	94,000.00	WIHLBORGS FASTIGHETER AB.	582,331.11	0.01
50,400.00	KOBAYASHI PHARMACEUTICAL CO	3,014,060.71	0.05		Suisse	384,593,868.58	6.07
25,900.00	KOSE CORP	2,721,520.68	0.04	12,447.00	ALCON - REGISTERED SHS	750,537.83	0.01
				164,590.00	CHUBB - NAMEN AKT	30,557,473.79	0.48

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	
	EUR		
7,918.00	FLUGHAFEN ZUERICH AG	1,206,341.22	0.02
75,245.00	GEBERIT AG	33,361,582.14	0.53
6,538.00	GIVAUDAN SA REG.SHS	20,362,594.90	0.32
1,989.00	KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG	416,695.71	0.01
3,243.00	LONZA GROUP (CHF)	1,635,626.32	0.03
433,872.00	NESTLE SA REG SHS	48,184,001.00	0.76
736,878.00	NOVARTIS AG REG SHS	57,722,874.24	0.90
263,926.00	ROCHE HOLDING LTD	88,536,470.34	1.39
18,585.00	SCHINDLER HOLDING SA	2,980,885.97	0.05
58,330.00	SWISS RE REGS	4,425,868.91	0.07
4,879.00	SWISSCOM SHS NOM	2,345,381.14	0.04
79,563.00	TE CONNECTIVITY LTD REG SHS	8,962,969.10	0.14
466,782.00	TEMENOS AG NAM.AKT	32,648,597.88	0.52
740,043.00	UBS GROUP SA	11,109,855.25	0.18
96,142.00	ZURICH INSURANCE GROUP NAMENSAKT	39,386,112.84	0.62
Total portefeuille-titres	6,379,914,970.95	100.75	

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	323,002,791.41	98.61			
Actions	323,002,791.41	98.61			
Allemagne	7,853,546.59	2.40			
2.00 ALLIANZ SE REG SHS	323.60	0.00	16,185.00 FIFTH THIRD BANCORP	528,017.76	0.16
5.00 COVESTRO AG	147.70	0.00	80,302.00 FIRSTENERGY CORP	3,032,893.38	0.93
298,425.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	2,281,757.55	0.70	71,960.00 GENERAL MOTORS CO	2,357,164.70	0.72
1,866.00 RWE AG	70,516.14	0.02	4,764.00 GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,425,090.80	0.44
43,519.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	5,500,801.60	1.68	10,617.00 HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,809,544.73	0.55
Autriche	22.64	0.00	4,084.00 HUMANA INC	2,022,677.45	0.62
1.00 ERSTE GROUP BANK AG	22.64	0.00	5,422.00 ILLUMINA INC	1,055,952.00	0.32
Espagne	9,317,963.47	2.84	141,835.00 INTEL CORP	3,731,014.09	1.14
1,503,026.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	3,603,504.84	1.09	10,235.00 INTUIT	4,046,567.86	1.24
90,826.00 ENDESA	1,400,536.92	0.43	105,836.00 JOHNSON & JOHNSON	17,648,516.27	5.39
111,980.00 FERROVIAL SA	2,619,212.20	0.80	533.00 KIMBERLY-CLARK CORP	61,229.85	0.02
27.00 REPSOL SA	318.74	0.00	30,895.00 KINDER MORGAN INC	524,771.91	0.16
501,893.00 TELEFONICA SA	1,694,390.77	0.52	27,442.00 LOWE'S CO INC	5,260,942.19	1.61
Etats-Unis d'Amérique	278,696,182.43	85.09	9,925.00 MARATHON PETROLEUM	1,006,329.05	0.31
64,629.00 ABBOTT LABORATORIES	6,383,404.32	1.95	14,913.00 MARTIN MARIETTA	4,903,106.38	1.50
20,122.00 ACTIVISION BLIZZARD	1,526,942.77	0.47	141,033.00 MERCK & CO INC	12,398,062.53	3.79
1.00 AKAMAI TECHNOLOGIES	81.99	0.00	780.00 METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	863,179.30	0.26
103,307.00 ALPHABET INC -A-	10,086,576.38	3.08	14,933.00 MOSAIC	736,703.81	0.22
170,000.00 ALPHABET INC -C-	16,685,040.58	5.09	1.00 NETAPP	63.13	0.00
2,155.00 AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	190,169.70	0.06	4,981.00 NEXTERA ENERGY	398,673.21	0.12
13,780.00 AMERICAN EXPRESS	1,897,677.54	0.58	47,725.00 NIKE INC	4,049,305.36	1.24
9,115.00 AMGEN INC	2,097,199.00	0.64	47,213.00 ORGANON --- REGISTERED SHS	1,127,733.58	0.34
157.00 AMPHENOL -A-	10,731.10	0.00	1,946.00 PAYCHEX INC	222,896.61	0.07
25,895.00 APA - REGISTERED SHS	903,741.18	0.28	11,049.00 PAYCOM SOFTWARE INC	3,721,798.10	1.14
165,604.00 APPLE INC	23,361,887.20	7.14	185,092.00 PFIZER INC	8,267,877.22	2.52
1,694.00 ARISTA NETWORKS INC	195,208.15	0.06	69,682.00 PROGRESSIVE CORP	8,265,957.45	2.52
17,753.00 AUTOMATIC DATA PROCESSING INC	4,098,965.01	1.25	30,011.00 QORVO INC	2,432,678.52	0.74
7,536.00 AVERY DENNISON CORP	1,251,576.79	0.38	34,590.00 QUALCOMM INC	3,989,157.56	1.22
87,142.00 BANK OF AMERICA CORP	2,686,355.74	0.82	14,813.00 ROBERT HALF INTERNATIONAL INC	1,156,734.04	0.35
273,830.00 BAXTER INTERNATIONAL INC	15,054,850.00	4.60	2,399.00 SALESFORCE INC	352,240.25	0.11
18,740.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	5,107,900.58	1.56	3.00 SOUTHERN CO	208.24	0.00
34,202.00 CITIGROUP INC	1,454,802.57	0.44	43,060.00 SYNCHRONY FINANCIAL	1,239,076.61	0.38
41,115.00 CITIZENS FINANCIAL GROUP INC	1,442,057.27	0.44	73,274.00 SYSCO CORP	5,288,832.28	1.61
7,097.00 CME GROUP -A-	1,283,204.83	0.39	3,762.00 T MOBILE USA INC	515,232.52	0.16
18,935.00 CMS ENERGY CORP	1,125,682.03	0.34	4,474.00 TELEFLEX INC	920,055.16	0.28
8.00 COCA-COLA CO	457.47	0.00	4,716.00 TEXAS INSTRUMENTS INC	745,105.37	0.23
21,305.00 COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS -A-	1,249,180.01	0.38	18,970.00 THERMO FISHER SCIENT SHS	9,821,256.88	3.00
34,279.00 CONSTELLATION BRANDS INC -A-	8,036,748.55	2.45	221.00 TRIMBLE	12,242.81	0.00
213,342.00 CORNING INC	6,319,792.62	1.93	114,312.00 TWITTER INC	5,115,539.30	1.56
612.00 COSTCO WHOLESALE CORP	295,033.16	0.09	54,463.00 TYSON FOODS INC -A-	3,665,335.16	1.12
443,679.00 CSX CORP	12,065,134.04	3.68	14.00 UNDER ARMOUR INC -A-	95.03	0.00
159,011.00 DELTA AIR LINES	4,554,533.41	1.39	7,287.00 UNION PACIFIC CORP	1,449,143.41	0.44
340.00 DOW - REGISTERED SHS	15,246.47	0.00	5,225.00 VISA INC -A-	947,502.93	0.29
17,631.00 DOWDUPONT - REGISTERED SHS WI	907,061.09	0.28	2,192.00 VULCAN MATERIALS CO	352,881.46	0.11
1,640.00 DUKE ENERGY CORP	155,721.74	0.05	3.00 WASTE MANAGEMENT	490.61	0.00
24,435.00 DXC TECHNOLOGY	610,594.40	0.19	1,934.00 WEC ENERGY GR	176,550.42	0.05
3,458.00 EDWARDS LIFSCIENCES CORP	291,670.03	0.09	7,895.00 WELLS FARGO AND CO	324,133.01	0.10
12,233.00 ELI LILLY & CO	4,037,707.91	1.23	11,879.00 WESTROCK	374,564.70	0.11
1,396.00 ENPHASE ENERGY	395,394.40	0.12	46,915.00 WILLIAMS-SONOMA	5,643,783.75	1.72
100,186.00 EXXON MOBIL CORP	8,928,943.66	2.73	Finlande	509.49	0.00
			37.00 FORTUM CORP	509.49	0.00
			France	1,934,326.88	0.59
			1,613.00 L'OREAL SA	532,693.25	0.16
			1,514.00 LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	924,145.60	0.28
			9,891.00 TOTALENERGIESSE	477,488.03	0.15

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR	
Irlande	3,081,541.31	0.94
3.00 ACCENTURE - SHS CLASS A	787.93	0.00
11,195.00 LINDE PLC	3,080,753.38	0.94
Panama	136.34	0.00
19.00 CARNIVAL CORP	136.34	0.00
Pays-Bas	517,017.77	0.16
1,403.00 ARGEX SE	517,005.50	0.16
1.00 STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	12.27	0.00
Royaume-Uni	8,590,217.78	2.62
197,264.00 SHELL PLC	5,056,862.64	1.54
78,137.00 UNILEVER	3,533,355.14	1.08
Suisse	13,011,326.71	3.97
264.00 BALOISE HOLDING REG.SHS	34,690.73	0.01
225.00 BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	436,138.77	0.13
12,565.00 FLUGHAFEN ZUERICH AG	1,914,331.57	0.58
4,570.00 GEBERIT AG	2,026,213.44	0.62
28,871.00 HELVETIA HLDG - REGISTERED SHS	2,781,700.79	0.85
2,560.00 LONZA GROUP (CHF)	1,291,151.21	0.39
2,917.00 NESTLE SA REG SHS	323,949.76	0.10
20,043.00 NOVARTIS AG REG SHS	1,570,055.79	0.48
3,987.00 SWISSCOM SHS NOM	1,916,588.36	0.59
10,244.00 TEMENOS AG NAM.AKT	716,506.29	0.22
Total portefeuille-titres	323,002,791.41	98.61

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	14,042,575.93	99.67	Panama	7.18	0.00
Actions	14,042,575.93	99.67	1.00 CARNIVAL CORP	7.18	0.00
Allemagne	374,773.56	2.66	Pays-Bas	514,508.30	3.65
9.00 ALLIANZ SE REG SHS	1,456.20	0.01	5,627.00 AIRBUS SE	500,184.03	3.55
1.00 PORSCHE AUTOMOBIL HLDG - VORZ.AKT-STIMMR	58.16	0.00	10.00 ASML HOLDING NV	4,336.00	0.03
2,953.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	373,259.20	2.65	37.00 DSM KONINKLIJKE	4,345.65	0.03
Espagne	2,136,798.09	15.17	143.00 KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	3,737.31	0.03
11,250.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	26,971.88	0.19	1.00 NN GROUP NV	39.97	0.00
37,618.00 ENAGAS	595,869.12	4.23	152.00 STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	1,865.34	0.01
352.00 INDITEX SHARE FROM SPLIT	7,490.56	0.05	Royaume-Uni	404,665.82	2.87
105,351.00 REPSOL SA	1,243,668.56	8.83	174.00 RELX PLC	4,360.44	0.03
77,843.00 TELEFONICA SA	262,797.97	1.87	15,448.00 SHELL PLC	396,009.48	2.81
Etats-Unis d'Amérique	7,577,738.87	53.78	95.00 UNILEVER	4,295.90	0.03
390.00 ADOBE INC	109,557.50	0.78	Suisse	927,301.22	6.58
1.00 AKAMAI TECHNOLOGIES	81.99	0.00	149.00 LONZA GROUP (CHF)	75,149.04	0.53
9,060.00 ALPHABET INC -A-	884,590.41	6.28	1,530.00 NESTLE SA REG SHS	169,915.37	1.21
960.00 ALPHABET INC -C-	94,221.41	0.67	243.00 ROCHE HOLDING LTD	81,516.65	0.58
1,615.00 APPLE INC	227,829.33	1.62	129.00 SWISSCOM SHS NOM	62,011.51	0.44
19,202.00 AT&T INC	300,677.47	2.13	7,702.00 TEMENOS AG NAM.AKT	538,708.65	3.82
256.00 BROADCOM INC - REGISTERED SHS	116,027.72	0.82	Total portefeuille-titres	14,042,575.93	99.67
632.00 CHEVRON CORP	92,685.59	0.66			
3,139.00 CLOROX CO	411,387.95	2.92			
667.00 COSTCO WHOLESALE CORP	321,547.58	2.28			
1.00 DXC TECHNOLOGY	24.99	0.00			
1,624.00 EDWARDS LIFESCIENCES CORP	136,978.64	0.97			
295.00 ELEVANCE HEALTH	136,784.36	0.97			
1.00 HOLOGIC INC	65.86	0.00			
13.00 HONEYWELL INTERNATIONAL INC	2,215.70	0.02			
1,091.00 J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	174,199.17	1.24			
1,813.00 LULULEMON ATHLETICA INC SHS WHEN ISSUED	517,370.78	3.67			
2,567.00 META PLATFORMS INC A	355,525.50	2.52			
411.00 METTLER TOLEDO INTERNATIONAL	454,829.09	3.23			
274.00 MICROSOFT CORP	65,140.20	0.46			
5,978.00 PAYPAL HOLDINGS	525,214.58	3.73			
5,846.00 QORVO INC	473,874.20	3.36			
336.00 RAYTHEON TECHNOLOGIES CORPORATION	28,076.31	0.20			
47.00 SERVICENOW INC	18,116.34	0.13			
3,390.00 T MOBILE USA INC	464,284.49	3.30			
3,369.00 TESLA MOTORS INC	912,190.32	6.47			
1,290.00 THERMO FISHER SCIENT SHS	667,866.18	4.74			
4.00 UNDER ARMOUR INC -A-	27.15	0.00			
528.00 WASTE MANAGEMENT	86,348.06	0.61			
Finlande	5,163.75	0.04			
375.00 FORTUM CORP	5,163.75	0.04			
Irlande	1,746,385.64	12.40			
3,659.00 ACCENTURE - SHS CLASS A	961,017.40	6.83			
9,528.00 MEDTRONIC HLD	785,368.24	5.57			
Luxembourg	355,233.50	2.52			
670.00 SES GLOBAL CERT.GC FID.DEP.REC(1-A-SHS)	3,764.06	0.03			
26,496.00 TENARIS SA - REG.SHS	351,469.44	2.49			

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	28,565,352.78	100.12	Finlande	100,576.08	0.35
Actions	28,565,352.78	100.12	7,304.00 FORTUM CORP	100,576.08	0.35
Allemagne	2,465,811.90	8.64	Luxembourg	1,363,247.65	4.78
15,463.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	118,230.10	0.41	17,171.00 SES GLOBAL CERT.GC FID.DEP.REC(1-A-SHS)	96,466.68	0.34
1,874.00 PORSCHE AUTOMOBIL HLDG - VORZ.AKT-STIMMR	108,991.84	0.38	95,498.00 TENARIS SA - REG.SHS	1,266,780.97	4.44
4,283.00 SAP AG	360,285.96	1.26	Panama	43,996.25	0.15
14,860.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	1,878,304.00	6.59	6,131.00 CARNIVAL CORP	43,996.25	0.15
Autriche	22.64	0.00	Pays-Bas	1,101,527.24	3.86
1.00 ERSTE GROUP BANK AG	22.64	0.00	16,744.00 AEGON NV	68,683.89	0.24
Belgique	11,947.90	0.04	1,194.00 AIRBUS SE	106,134.66	0.37
29.00 COFINIMMO SA	2,459.20	0.01	1,477.00 ARGEX SE	544,274.50	1.90
195.00 KBC GROUPE SA	9,488.70	0.03	479.00 ASML HOLDING NV	207,694.40	0.73
Espagne	4,417,734.42	15.48	2.00 ING GROUP NV	17.72	0.00
736,220.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	1,765,087.45	6.18	2,459.00 JDE PEET S BV	73,622.46	0.26
31,084.00 FERROVIAL SA	727,054.76	2.55	3,226.00 KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	84,311.51	0.30
89,360.00 REPSOL SA	1,054,894.80	3.70	1,368.00 STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	16,788.10	0.06
257,908.00 TELEFONICA SA	870,697.41	3.05	Portugal	92,087.70	0.32
Etats-Unis d'Amérique	17,631,264.21	61.81	4,834.00 JERONIMO MARTINS SGPS SA	92,087.70	0.32
9,326.00 ABBOTT LABORATORIES	921,128.73	3.23	Royaume-Uni	630,506.43	2.21
12,605.00 ALPHABET INC -A-	1,230,713.26	4.31	4,814.00 RELX PLC	120,638.84	0.42
3,840.00 ALPHABET INC -C-	376,885.62	1.32	10,214.00 SHELL PLC	261,835.89	0.92
9,212.00 A.O.SMITH CORP	456,815.15	1.60	5,485.00 UNILEVER	248,031.70	0.87
14,879.00 APPLE INC	2,098,992.29	7.37	Suisse	706,630.36	2.48
2,663.00 AVERY DENNISON CORP	442,270.30	1.55	217.00 LONZA GROUP (CHF)	109,445.24	0.38
4,788.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	1,305,049.52	4.57	3,010.00 NOVARTIS AG REG SHS	235,786.46	0.83
3.00 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	217.70	0.00	712.00 ROCHE HOLDING LTD	238,847.13	0.84
636.00 BROADCOM INC - REGISTERED SHS	288,256.38	1.01	219.00 SWISSCOM SHS NOM	105,275.36	0.37
2,467.00 CMS ENERGY CORP	146,662.67	0.51	247.00 TEMENOS AG NAM.AKT	17,276.17	0.06
3,855.00 CONSTELLATION BRANDS INC -A-	903,808.91	3.17	Total portefeuille-titres	28,565,352.78	100.12
120.00 COPART INC	13,033.23	0.05			
152.00 COSTCO WHOLESALE CORP	73,276.21	0.26			
875.00 DXC TECHNOLOGY	21,864.95	0.08			
20,740.00 HALLIBURTON	521,225.74	1.83			
1,455.00 ILLUMINA INC	283,365.95	0.99			
30,825.00 INTEL CORP	810,861.28	2.84			
1,701.00 IPG PHOTONICS CORP	146,459.81	0.51			
6,057.00 META PLATFORMS INC A	838,885.07	2.94			
23.00 METLIFE INC	1,426.98	0.01			
4,314.00 MOSAIC	212,826.64	0.75			
662.00 NETFLIX INC	159,098.94	0.56			
5,709.00 NIKE INC	484,389.40	1.70			
5,468.00 ORACLE CORP	340,867.41	1.19			
1.00 PAYPAL HOLDINGS	87.86	0.00			
7.00 PFIZER INC	312.68	0.00			
15,176.00 SYSCO CORP	1,095,386.07	3.84			
6,132.00 TESLA MOTORS INC	1,660,300.11	5.82			
2,897.00 THERMO FISHER SCIENT SHS	1,499,851.41	5.26			
5.00 UNDER ARMOUR INC -A-	33.94	0.00			
10,646.00 VMWARE INC -A-	1,156,916.41	4.05			
3,292.00 ZOOMINFO TECH --- REGISTERED SHS -A-	139,993.59	0.49			

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	335,170,666.31	100.01			
Actions	335,170,666.31	100.01			
Allemagne	2,300,331.53	0.69			
1,773.00 ALLIANZ SE REG SHS	286,871.40	0.09	6,805.00 CME GROUP -A-	1,230,408.46	0.37
9,066.00 BAYER AG REG SHS	429,864.39	0.13	91,683.00 CMS ENERGY CORP	5,450,536.33	1.63
59,210.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	452,719.66	0.14	6,024.00 COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS -A-	353,206.31	0.11
1,522.00 FRESENIUS SE	33,407.90	0.01	27,211.00 CONSOLIDATED EDISON INC	2,382,090.91	0.71
27,828.00 SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	316,821.78	0.09	7,078.00 CONSTELLATION BRANDS INC -A-	1,659,444.74	0.50
6,176.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	780,646.40	0.23	19,447.00 COPART INC	2,112,142.91	0.63
			1,878.00 COSTCO WHOLESALE CORP	905,346.87	0.27
Autriche	22.64	0.00	5,808.00 CSX CORP	157,939.18	0.05
1.00 ERSTE GROUP BANK AG	22.64	0.00	54,036.00 CVS HEALTH	5,260,463.76	1.57
			67,990.00 DELTA AIR LINES	1,947,429.59	0.58
Belgique	7,834.26	0.00	5.00 DXC TECHNOLOGY	124.94	0.00
161.00 KBC GROUPE SA	7,834.26	0.00	90,244.00 ELECTRONIC ARTS - REGISTERED	10,659,044.80	3.18
			4,731.00 EMERSON ELECTRIC CO	353,599.57	0.11
Espagne	33,826,814.86	10.09	7,732.00 FIRSTENERGY CORP	292,026.74	0.09
4,831,623.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	11,583,816.14	3.46	46,271.00 FOX CORP -A-	1,449,083.12	0.43
2,357.00 FERROVIAL SA	55,130.23	0.02	47.00 FREEPORT MCMORAN COPPER AND GOLD INC	1,311.19	0.00
1,741,118.00 REPSOL SA	20,553,897.99	6.12	239,898.00 GILEAD SCIENCES INC	15,106,729.57	4.51
483,996.00 TELEFONICA SA	1,633,970.50	0.49	2,279.00 HOLOGIC INC	150,095.52	0.04
			3,667.00 HONEYWELL INTERNATIONAL INC	624,997.69	0.19
Etats-Unis d'Amérique	252,764,143.06	75.42	601,765.00 HP ENTERPRISE CO	7,358,898.28	2.20
10,481.00 ABBOTT LABORATORIES	1,035,208.04	0.31	99,824.00 HP INC	2,539,288.60	0.76
1,725.00 ADOBE INC	484,581.23	0.14	65.00 HUMANA INC	32,192.47	0.01
3.00 AKAMAI TECHNOLOGIES	245.97	0.00	13,149.00 ILLUMINA INC	2,560,810.20	0.76
149,458.00 ALPHABET INC -A-	14,592,617.47	4.35	113,857.00 INTEL CORP	2,995,044.04	0.89
96,973.00 ALPHABET INC -C-	9,517,637.88	2.84	22,655.00 IROBOT	1,302,665.39	0.39
6,594.00 AMERICIAN WATER WORKS CO INC	876,103.75	0.26	15,555.00 J.B. HUNT TRANSPORT SERVICES INC	2,483,655.49	0.74
13.00 AMEREN CORPORATION	1,068.90	0.00	86,249.00 KEYCORP	1,410,410.84	0.42
71,034.00 AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC	6,268,452.30	1.87	3,166.00 KROGER CO	141,389.78	0.04
12,235.00 AMERICAN EXPRESS	1,684,911.81	0.50	23,713.00 LAM RESEARCH CORP	8,859,243.61	2.64
3,229.00 AMERICAN INTL	156,497.65	0.05	3,309.00 LAMB WESTON HOLDINGS INC	2,995,369.28	0.89
100,569.00 AMETEK INC	11,642,454.23	3.47	16,875.00 LOWE'S CO INC	3,235,128.62	0.97
5,928.00 AMGEN INC	1,363,927.12	0.41	24,585.00 MARATHON PETROLEUM	2,492,755.63	0.74
7,557.00 AMPHENOL -A-	516,528.07	0.15	1,674.00 MARTIN MARIETTA	550,378.87	0.16
5,668.00 ANALOG DEVICES INC	806,184.98	0.24	4,117.00 MCDONALD'S CORP	969,689.77	0.29
3,941.00 APPLE INC	555,959.99	0.17	13,209.00 META PLATFORMS INC A	1,829,425.94	0.55
184,691.00 AT&T INC	2,892,012.39	0.86	7,675.00 MORGAN STANLEY	618,998.37	0.18
4,135.00 AUTODESK INC	788,463.23	0.24	11,890.00 NETFLIX INC	2,857,532.38	0.85
12,031.00 AVERY DENNISON CORP	1,998,105.14	0.60	441.00 NEXTERA ENERGY	35,297.11	0.01
73,488.00 BANK OF AMERICA CORP	2,265,439.29	0.68	5,926.00 ORACLE CORP	369,418.49	0.11
2,634.00 BANK OF NY MELLON	103,569.32	0.03	54,772.00 PEPSICO INC	9,127,828.02	2.72
23,953.00 BAXTER INTERNATIONAL INC	1,316,907.65	0.39	2,568.00 PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC	391,681.27	0.12
4,717.00 BECTON DICKINSON	1,072,923.09	0.32	244.00 PROCTER & GAMBLE CO	31,444.90	0.01
11,365.00 BERKSHIRE HATHAWAY -B-	3,097,720.92	0.92	18,851.00 PROGRESSIVE CORP	2,236,180.99	0.67
9,566.00 BIOGEN IDEC INC	2,607,178.07	0.78	45,618.00 QUALCOMM INC	5,260,982.64	1.57
103.00 BLACKROCK INC	57,856.21	0.02	40,991.00 SALESFORCE INC	6,018,624.45	1.80
3,631.00 BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	263,489.81	0.08	2,250.00 SERVICENOW INC	867,271.47	0.26
1,367.00 BROADCOM INC - REGISTERED SHS	619,569.92	0.18	38,017.00 SIGNATURE BANK	5,859,814.22	1.75
101,816.00 CENTERPOINT ENERGY	2,928,775.46	0.87	87,210.00 SOUTHWEST AIRLINES CO - REGISTERED	2,745,425.82	0.82
83,622.00 CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	8,215,809.22	2.45	6,286.00 S&P GLOBAL INC	1,959,301.89	0.58
6.00 CHARTER COMM -A-	1,857.91	0.00	2,326.00 SYSCO CORP	167,887.98	0.05
15,899.00 CHEVRON CORP	2,331,658.58	0.70	32,395.00 THERMO FISHER SCIENT SHS	16,771,724.65	5.00
67,543.00 CITIGROUP INC	2,872,981.99	0.86	5,394.00 TWITTER INC	241,385.15	0.07
14,175.00 CLOROX CO	1,857,733.12	0.55	1,038.00 UDR	44,194.33	0.01
			8,588.00 ULTA BEAUTY RG REGISTERED	3,516,990.48	1.05
			59,252.00 UNDER ARMOUR INC -A-	402,210.79	0.12
			38,868.00 UNION PACIFIC CORP	7,729,560.31	2.31
			94,802.00 VERIZON COMMUNICATIONS INC	3,674,406.10	1.10

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR	
30,215.00 VIATRIS INC - REGISTERED SHS	262,779.36	0.08
26,341.00 VMWARE INC -A-	2,862,515.04	0.85
7,971.00 VULCAN MATERIALS CO	1,283,219.94	0.38
2,468.00 WALMART INC	326,748.94	0.10
11,587.00 WATERS	3,187,918.25	0.95
Irlande	1,614,101.80	0.48
364.00 ACCENTURE - SHS CLASS A	95,602.72	0.03
5,518.00 LINDE PLC	1,518,499.08	0.45
Israël	4,980,435.57	1.49
56,476.00 NOVA LTD	4,980,435.57	1.49
Luxembourg	1,013,106.36	0.30
64,182.00 SES GLOBAL CERT.GC FID.DEP.REC(1-A-SHS)	360,574.48	0.11
49,192.00 TENARIS SA - REG.SHS	652,531.88	0.19
Panama	78.94	0.00
11.00 CARNIVAL CORP	78.94	0.00
Pays-Bas	8,934,041.13	2.67
10,777.00 AEGON NV	44,207.25	0.01
19,917.00 AIRBUS SE	1,770,422.13	0.53
7,372.00 AKZO NOBEL NV	429,935.04	0.13
7,039.00 ING GROUP NV	62,351.46	0.02
2,342.00 JDE PEET S BV	70,119.48	0.02
11,561.00 KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	302,146.74	0.09
18,213.00 KONINKLIJKE KPN NV	50,486.44	0.02
28,387.00 ROYAL PHILIPS NV	454,192.00	0.14
468,561.00 STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	5,750,180.59	1.71
Portugal	44,043.60	0.01
2,312.00 JERONIMO MARTINS SGPS SA	44,043.60	0.01
Royaume-Uni	21,609,782.62	6.45
18,105.00 RELX PLC	453,711.30	0.14
791,188.00 SHELL PLC	20,282,104.38	6.05
19,327.00 UNILEVER	873,966.94	0.26
Suisse	8,075,929.94	2.41
188.00 BALOISE HOLDING REG.SHS	24,704.00	0.01
306.00 BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	593,148.72	0.18
41.00 GEBERIT AG	18,178.28	0.01
290.00 LONZA GROUP (CHF)	146,263.22	0.04
3,225.00 NESTLE SA REG SHS	358,154.95	0.11
18,906.00 NOVARTIS AG REG SHS	1,480,989.61	0.44
10,441.00 ROCHE HOLDING LTD	3,502,532.10	1.04
286.00 SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	130,067.41	0.04
980.00 SWISSCOM SHS NOM	471,095.21	0.14
17,368.00 TEMENOS AG NAM.AKT	1,214,787.31	0.36
332.00 ZURICH INSURANCE GROUP NAMENSAKT	136,009.13	0.04
Total portefeuille-titres	335,170,666.31	100.01

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	12,442,782.01	99.75	Luxembourg	29,374.86	0.24
Actions	12,442,782.01	99.75	13,015.00 AROUNDTOWN SA	29,374.86	0.24
			Total portefeuille-titres	12,442,782.01	99.75
Allemagne	11,500,981.55	92.20			
2,526.00 ADIDAS AG NAMEN AKT	300,290.88	2.41			
5,553.00 ALLIANZ SE REG SHS	898,475.40	7.19			
453.00 AURUBIS	24,452.94	0.20			
13,469.00 BASF SE REG SHS	533,372.40	4.28			
14,761.00 BAYER AG REG SHS	699,892.82	5.61			
1,470.00 BEIERSDORF AG	148,396.50	1.19			
4,727.00 BMW AG	330,842.73	2.65			
2,321.00 BRENNTAG - NAMEN AKT	144,783.98	1.16			
549.00 CARL ZEISS MEDITEC AG	58,990.05	0.47			
15,881.00 COMMERZBK	116,598.30	0.93			
1,623.00 CONTINENTAL AG	74,576.85	0.60			
2,851.00 COVESTRO AG	84,218.54	0.68			
30,643.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	234,296.38	1.88			
2,759.00 DEUTSCHE BOERSE AG REG SHS	464,201.75	3.72			
13,484.00 DEUTSCHE LUFTHANSA AG REG SHS	79,798.31	0.64			
14,545.00 DEUTSCHE POST AG REG SHS	452,567.68	3.63			
49,429.00 DEUTSCHE TELEKOM AG REG SHS	864,612.07	6.93			
3,081.00 EVONIK INDUSTRIES	53,147.25	0.43			
1,786.00 FREENET AG REG SHS	34,737.70	0.28			
2,990.00 FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	86,799.70	0.70			
6,228.00 FRESENIUS SE	136,704.60	1.10			
2,229.00 GEA GROUP AG	74,314.86	0.60			
902.00 HANNOVER RUECK SE	139,088.40	1.12			
2,072.00 HEIDELBERGCEMENT AG	84,641.20	0.68			
2,519.00 HENKEL AG & CO KGAA	153,709.38	1.23			
873.00 HUGO BOSS AG	41,956.38	0.34			
19,566.00 INFINEON TECHNOLOGIES REG SHS	444,343.86	3.56			
1,078.00 KION GROUP AG	21,360.57	0.17			
993.00 KNORR-BREMSE - BEARER SHS	44,069.34	0.35			
2,876.00 K+S	55,794.40	0.45			
1,228.00 LANXESS AG	36,925.96	0.30			
1,113.00 LEG IMMOBILIEN - NAMEN AKT	68,293.68	0.55			
11,814.00 MERCEDES-BENZ GROUP	618,462.90	4.96			
1,942.00 MERCK KGAA	323,925.60	2.60			
2,087.00 MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG REG SHS	516,532.50	4.14			
2,301.00 PORSCHE AUTOMOBIL HLDG - VORZ.AKT-STIMMR	133,826.16	1.07			
1,511.00 PUMA AG	72,482.67	0.58			
10,886.00 SAP AG	915,730.32	7.33			
370.00 SARTORIUS VORZ.OHNE STIMMRECHT	132,127.00	1.06			
1,157.00 SCOUT24	59,840.04	0.48			
9,023.00 SIEMENS AG REG	913,127.60	7.31			
6,977.00 SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	79,433.15	0.64			
4,178.00 SIEMENS HEALTHINEERS	185,001.84	1.48			
1,995.00 SYMRISE AG	200,397.75	1.61			
2,637.00 TAG IMMOBILIEN AG	21,662.96	0.17			
7,396.00 THYSSENKRUPP AG	32,438.86	0.26			
10,777.00 VONOVIA SE	239,357.17	1.92			
3,479.00 ZALANDO SE	70,380.17	0.56			
Irlande	912,425.60	7.31			
3,268.00 LINDE PLC	912,425.60	7.31			

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	144,667,021.00	99.33	264.00 WACKER CHEMIE AG	28,023.60	0.02
Actions	144,654,001.05	99.32	3,797.00 ZALANDO SE	76,813.31	0.05
Allemagne	16,251,435.14	11.16	Autriche	533,645.72	0.37
3,085.00 ADIDAS AG NAMEN AKT	366,744.80	0.25	3,824.00 AMS-OSRAM AG	24,771.52	0.02
1,525.00 AIXTRON AG	38,018.25	0.03	1,009.00 ANDRITZ AG	44,032.76	0.03
7,844.00 ALLIANZ SE REG SHS	1,269,159.20	0.87	5,985.00 ERSTE GROUP BANK AG	135,500.40	0.10
1,897.00 AURUBIS	102,400.06	0.07	2,316.00 OMV AG	86,548.92	0.06
17,091.00 BASF SE REG SHS	676,803.60	0.46	1,375.00 VERBUND AG	120,243.75	0.08
18,936.00 BAYER AG REG SHS	897,850.44	0.62	5,287.00 VOESTALPINE AG	92,575.37	0.06
1,558.00 BECHTLE	57,848.54	0.04	1,455.00 WIENERBERGER AG	29,973.00	0.02
1,885.00 BEIERSDORF AG	190,290.75	0.13	Belgique	2,034,546.07	1.40
6,213.00 BMW AG	434,847.87	0.30	323.00 ACKERMANS AND VAN HAAREN NV	42,022.30	0.03
3,042.00 BRENNTAG - NAMEN AKT	189,759.96	0.13	673.00 AEDIFICA SA	53,066.05	0.04
1,578.00 CAPITAL STAGE AG	29,161.44	0.02	2,987.00 AGEAS NOM	111,833.28	0.08
678.00 CARL ZEISS MEDITEC AG	72,851.10	0.05	17,235.00 ANHEUSER-BUSCH INBEV	805,650.08	0.56
18,259.00 COMMERZBK	134,057.58	0.09	551.00 COFINIMMO SA	46,724.80	0.03
1,776.00 CONTINENTAL AG	81,607.20	0.06	319.00 D'IETAREN	46,350.70	0.03
3,685.00 COVESTRO AG	108,854.90	0.07	513.00 ELIA SYSTEM OPERATOR SA	61,765.20	0.04
39,825.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	304,501.95	0.21	1,938.00 GROUPE BRUXELLES LAMBERT GBL	139,303.44	0.10
3,522.00 DEUTSCHE BOERSE AG REG SHS	592,576.50	0.41	4,813.00 KBC GROUPE SA	234,200.58	0.16
8,882.00 DEUTSCHE LUFTHANSA AG REG SHS	52,563.68	0.04	2,913.00 PROXIMUS SA	30,863.24	0.02
18,295.00 DEUTSCHE POST AG REG SHS	569,248.93	0.39	1,445.00 SOLVAY	115,079.80	0.08
66,659.00 DEUTSCHE TELEKOM AG REG SHS	1,165,999.23	0.80	2,295.00 UCB	163,220.40	0.11
3,724.00 EVONIK INDUSTRIES	64,239.00	0.04	3,948.00 UMICORE SA	118,953.24	0.08
3,766.00 FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	109,326.98	0.08	2,608.00 WAREHOUSES DE PAUW SCA - REGISTERED SHS	65,512.96	0.04
7,452.00 FRESENIUS SE	163,571.40	0.11	Bermudes	67,658.04	0.05
2,808.00 GEA GROUP AG	93,618.72	0.06	6,729.00 HISCOX	67,658.04	0.05
1,157.00 HANNOVER RUECK SE	178,409.40	0.12	Danemark	5,791,039.07	3.98
2,855.00 HEIDELBERGCEMENT AG	116,626.75	0.08	3,214.00 AMBU AS - BEARER -B-	28,710.29	0.02
2,819.00 HELLOFRESH SE	61,313.25	0.04	102.00 A.P. MOELLER-MAERSK A/S -B-	190,201.00	0.13
3,390.00 HENKEL AG & CO KGAA	206,857.80	0.14	1,924.00 CARLSBERG AS -B-	231,280.04	0.16
846.00 HUGO BOSS AG	40,658.76	0.03	1,907.00 CHRISTIAN HANSEN	96,126.48	0.07
24,189.00 INFINEON TECHNOLOGIES REG SHS	549,332.19	0.38	2,367.00 COLOPLAST -B-	246,968.05	0.17
1,048.00 KION GROUP AG	20,766.12	0.01	13,212.00 DANSKE BANK	168,520.54	0.12
917.00 KNORR-BREMSE - BEARER SHS	40,696.46	0.03	1,870.00 DEMANT A/S	47,520.53	0.03
1,560.00 LANXESS AG	46,909.20	0.03	3,743.00 DSV A/S	451,045.73	0.31
1,350.00 LEG IMMOBILIEN - NAMEN AKT	82,836.00	0.06	2,367.00 GN GREAT NORDIC	42,689.37	0.03
15,190.00 MERCEDES-BENZ GROUP	795,196.50	0.55	2,684.00 ISS A/S	42,486.57	0.03
2,537.00 MERCK KGAA	423,171.60	0.29	626.00 JYSKE BANK A/S	33,474.45	0.02
2,702.00 MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG REG SHS	668,745.00	0.46	2,460.00 LK-ABELLO --- BEARER AND/OR REGISTERED S	39,966.38	0.03
2,951.00 PORSCHE AUTOMOBIL HLDG - VORZ.AKT-STIMMR	171,630.16	0.12	588.00 NETCOMPANY GROUP A/S	20,260.45	0.01
1,665.00 PUMA AG	79,870.05	0.05	31,253.00 NOVO NORDISK	3,200,348.90	2.19
20,785.00 SAP AG	1,748,434.20	1.20	4,009.00 NOVOZYMES -B-	206,611.41	0.14
441.00 SARTORIUS VORZ.OHNE STIMMRECHT	157,481.10	0.11	1,817.00 PANDORA	87,753.22	0.06
1,297.00 SCOUT24	67,080.84	0.05	162.00 ROCKWOOL SHS -B-	26,210.38	0.02
14,290.00 SIEMENS AG REG	1,446,148.00	0.99	608.00 ROYAL UNIBREW A/S	40,468.19	0.03
8,994.00 SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	102,396.69	0.07	751.00 SIMCORP A/S	43,421.03	0.03
5,213.00 SIEMENS HEALTHINEERS	230,831.64	0.16	597.00 TOPDANMARK AS	28,535.43	0.02
2,630.00 SYMRISE AG	264,183.50	0.18	6,688.00 TRYG A/S	141,127.60	0.10
11,803.00 TELEFONICA NAMEN AKT	24,467.62	0.02	19,810.00 VESTAS WIND SYSTEMS - BEARER AND/OR SHS	377,313.03	0.26
6,368.00 THYSSENKRUPP AG	27,930.05	0.02	Espagne	5,851,374.91	4.02
1,562.00 UNITED INTERNET AG REG SHS	30,084.12	0.02	456.00 ACCIONA SA	82,353.60	0.06
3,919.00 VOLKSWAGEN AG VORZ.AKT	495,361.60	0.34	4,394.00 ACS	101,633.22	0.07
13,655.00 VONOVIA SE	303,277.55	0.21	1,298.00 AENA SME SA	138,756.20	0.10

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets		
	EUR			EUR			
8,788.00	AMADEUS IT GROUP SA -A-	421,033.08	0.29	650.00	COVIVIO SA	32,188.00	0.02
111,758.00	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	516,377.84	0.35	24,801.00	CREDIT AGRICOLE SA	207,435.56	0.14
104,322.00	BANCO SABADELL REG.SHS	71,815.26	0.05	12,318.00	DANONE SA	598,285.26	0.41
313,433.00	BANCO SANTANDER SA REG SHS	751,455.62	0.52	13,671.00	DASSAULT SYST.	488,533.19	0.34
11,915.00	BANKINTER SA REGS	68,701.89	0.05	4,545.00	EDENRED SA	215,251.20	0.15
79,113.00	CAIXABANK SA	261,943.14	0.18	11,587.00	EDF SA	137,769.43	0.09
10,507.00	CELLNEX TELECOM SA	334,017.53	0.23	1,817.00	EIFFAGE	149,938.84	0.10
4,572.00	EDP RENOVAVEIS SA	96,194.88	0.07	3,484.00	ELIS SA	36,198.76	0.02
4,371.00	ENAGAS	69,236.64	0.05	36,352.00	ENGIE SA	430,480.38	0.30
10,019.00	FERROVIAL SA	234,344.41	0.16	5,767.00	ESSILORLUXOTTICA SA	809,398.45	0.56
4,158.00	GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA SA	74,532.15	0.05	962.00	EURAZEO	51,803.70	0.04
5,443.00	GRIFOLS SA -A-	48,344.73	0.03	3,141.00	FAURECIA	35,273.43	0.02
111,743.00	IBERDROLA SA	1,070,721.43	0.73	554.00	GAZTRANSPORT ET TECHNIGAZ SA	62,768.20	0.04
21,568.00	INDITEX SHARE FROM SPLIT	458,967.04	0.32	877.00	GECINA	70,554.65	0.05
5,544.00	INMOBILIARIA COLONIAL SA	27,365.18	0.02	8,099.00	GETLINK ACT	128,814.60	0.09
57,189.00	INTL CONS AIRLINES GROUP	61,691.92	0.04	682.00	HERMES INTERNATIONAL SA	829,994.00	0.57
6,224.00	MERLIN PROPERTIES SOCIMI S.A.	49,200.72	0.03	693.00	IPSEN	65,765.70	0.05
3,678.00	NATURGY ENERGY GROUP SA	87,278.94	0.06	1,398.00	KERING	641,052.90	0.44
7,820.00	RED ELECTRICA	122,852.20	0.08	3,806.00	KLEPIERRE SA	68,127.40	0.05
27,327.00	REPSOL SA	322,595.24	0.22	4,488.00	L OREAL-ACT REG PROV PRIM.FIDELITE 2013	1,482,162.00	1.02
112,548.00	TELEFONICA SA	379,962.05	0.26	2,114.00	LA FRANCAISE DES JEUX SA	64,413.58	0.04
	Finlande	3,343,682.48	2.30	5,030.00	LEGRAND SA	335,299.80	0.23
2,559.00	ELISA CORPORATION -A-	118,609.65	0.08	179.00	L'OREAL SA	59,114.75	0.04
1,378.00	HUHTAMAKI OYJ	45,005.48	0.03	4,982.00	LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	3,041,012.80	2.09
4,446.00	KESKO CORP	85,118.67	0.06	529.00	NEXANS SA	48,615.10	0.03
2,690.00	KOJAMO RG	35,292.80	0.02	40,068.00	ORANGE	370,548.86	0.25
7,649.00	KONE OYJ -B-	302,976.89	0.21	3,825.00	PERNOD RICARD SA	722,351.25	0.50
11,503.00	METSO OUTOTEC OYJ	78,864.57	0.05	4,528.00	PUBLICIS GROUPE	221,419.20	0.15
8,163.00	NESTE	365,702.40	0.25	362.00	REMY COINTREAU	61,865.80	0.04
102,707.00	NOKIA OYJ	454,016.29	0.31	3,837.00	RENAULT SA	107,320.89	0.07
69,396.00	NORDEA BK	610,684.80	0.43	4,529.00	REXEL SA	70,108.92	0.05
1,682.00	ORION CORPORATION (NEW) -B-	72,460.56	0.05	1,801.00	RUBIS	38,523.39	0.03
9,490.00	SAMPO OYJ -A-	415,282.40	0.29	22,015.00	SANOFI	1,725,976.00	1.19
16,695.00	STORA ENSO -R-	218,537.55	0.15	448.00	SARTORIUS STEDIM BIOTECH	142,060.80	0.10
1,244.00	TIETOEVRY CORP	28,935.44	0.02	10,967.00	SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,282,480.98	0.88
12,663.00	UPM KYMMENE CORP	412,560.54	0.28	3,176.00	SCOR SE ACT PROV REGROUPEMENT	47,211.24	0.03
2,492.00	VALMET CORPORATION	51,908.36	0.04	603.00	SEB SA	39,014.10	0.03
7,251.00	WARTSILA CORPORATION -B-	47,726.08	0.03	16,131.00	SOCIETE GENERALE SA	329,314.37	0.23
	France	23,910,080.20	16.42	1,565.00	SODEXO SA	120,755.40	0.08
3,372.00	ACCOR SA	72,868.92	0.05	466.00	SOITEC SA RGPT	55,290.90	0.04
518.00	AEROPORTS DE PARIS-ADP-	61,642.00	0.04	305.00	SOPRA STERIA GROUP	39,802.50	0.03
67.00	ALSTOM	1,121.92	0.00	2,646.00	SPIE SA	57,100.68	0.04
5,719.00	ALSTOM SA	95,764.66	0.07	1,132.00	TELEPERFORMANCE SE	295,338.80	0.20
544.00	ALTEN SA	61,852.80	0.04	50,062.00	TOTALENERGIESSE	2,416,743.05	1.66
1,150.00	AMUNDI SA	49,404.00	0.03	1,972.00	UNIBAIL RODAMCO	84,569.23	0.06
1,251.00	ARKEMA SA	93,925.08	0.06	4,035.00	VALEO SA	63,067.05	0.04
38,087.00	AXA SA	856,005.33	0.59	12,513.00	VEOLIA ENVIRONNEMENT SA	246,631.23	0.17
928.00	BIOMERIEUX SA	75,539.20	0.05	10,884.00	VINCI SA	905,222.28	0.62
21,904.00	BNP PARIBAS SA	955,123.92	0.66	12,988.00	VIVENDI SA	103,540.34	0.07
16,656.00	BOLLORE --- ACT	78,649.63	0.05	344.00	WENDEL SA	25,404.40	0.02
5,404.00	BOUYGUES SA	145,097.40	0.10	4,782.00	WORLDLINE SA	194,531.76	0.13
5,421.00	BUREAU VERITAS SA	124,574.58	0.09		Ile de Jersey	1,242,724.70	0.85
3,277.00	CAPGEMINI SE	542,343.50	0.37	17,900.00	EXPERIAN GROUP	542,751.82	0.37
10,857.00	CARREFOUR SA	154,332.26	0.11	4,111.00	FERGUSON NEWCO PLC	440,517.82	0.30
10,212.00	CIE DE SAINT-GOBAIN	378,354.60	0.26	29,082.00	MAN GROUP - REGISTERED SHS	74,262.49	0.05
13,260.00	CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	307,035.30	0.21	21,670.00	WPP PLC	185,192.57	0.13

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Ile de Man	149,300.25	0.10			
12,065.00 ENTAIN PLC	149,300.25	0.10	8,750.00 STOREBRAND	61,849.56	0.04
Irlande	4,086,450.36	2.81	4,332.00 TOMRA SYSTEMS ASA	78,065.68	0.05
17,795.00 BANK OF IRELAND - REGISTERED	117,197.87	0.08	2,820.00 YARA INTERNATIONAL ASA	101,251.09	0.07
15,083.00 CRH PLC	498,794.81	0.34	Pays-Bas	10,725,864.05	7.36
2,146.00 DCC PLC	114,660.37	0.08	1,778.00 AALBERTS N.V.	60,043.06	0.04
5,460.00 GRAFTON GRP UNITS CONS.OF 1 ORD+1C+17-A-	41,796.13	0.03	8,731.00 ABN AMRO GROUP DEP RECEIPT	80,569.67	0.06
2,923.00 KERRY GROUP -A-	266,577.60	0.18	31,812.00 AEGON NV	130,492.82	0.09
2,981.00 KINGSPAN GROUP	138,139.54	0.09	3,313.00 AKZO NOBEL NV	193,214.16	0.13
9,496.00 LINDE PLC	2,651,283.20	1.83	268.00 ALFEN NV	25,401.04	0.02
10,793.00 RYANAIR HLDGS	113,110.64	0.08	1,375.00 ARCADIS	46,200.00	0.03
4,940.00 SMURFIT KAPPA PLC	144,890.20	0.10	848.00 ASM INTERNATIONAL NV	198,220.00	0.14
Italie	3,455,286.56	2.37	7,756.00 ASML HOLDING NV	3,363,001.60	2.30
1,865.00 AMPLIFON SPA	50,168.50	0.03	2,292.00 ASR NEDERLAND NV	90,694.44	0.06
20,931.00 ASSICURAZIONI GENERALI SPA	293,452.62	0.20	1,544.00 BESI -REGISTERED SHS	68,846.96	0.05
9,409.00 ATLANTIA SPA	212,737.49	0.15	19,423.00 CNH INDUSTRIAL NV	225,889.49	0.16
29,042.00 A2A SPA	29,036.19	0.02	10,155.00 DAVIDE CAMPARI-MILANO N.V.	92,532.36	0.06
45,756.00 ENI SPA	499,197.96	0.34	3,322.00 DSM KONINKLIJKE	390,168.90	0.27
11,307.00 FINCOBANK	143,994.65	0.10	1,481.00 EURONEXT NV	96,413.10	0.07
14,940.00 HERA SPA	32,658.84	0.02	2,314.00 FERRARI NV	443,593.80	0.30
6,521.00 INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	58,493.37	0.04	1,929.00 HEINEKEN HOLDING	135,994.50	0.09
1,529.00 INTERPUMP GROUP	51,099.18	0.04	4,449.00 HEINEKEN NV	399,787.14	0.27
351,280.00 INTESA SANPAOLO	598,159.58	0.41	1,084.00 IMCD	132,898.40	0.09
9,081.00 ITALGAS SPA REG	43,370.86	0.03	71,606.00 ING GROUP NV	634,285.95	0.44
11,604.00 MADIOBANCA	93,528.24	0.06	2,479.00 JDE PEET S BV	74,221.26	0.05
3,613.00 MONCLER SPA	153,155.07	0.11	18,879.00 KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	493,402.67	0.34
12,378.00 NEXI SPA	103,257.28	0.07	63,040.00 KONINKLIJKE KPN NV	174,746.88	0.12
8,654.00 POSTE ITALIANE SPA	67,414.66	0.05	4,546.00 NN GROUP NV	181,703.62	0.12
5,114.00 PRYSMIAN SPA	151,476.68	0.10	1,500.00 OCI REG.SHS	56,340.00	0.04
1,917.00 RECORDATI SPA	72,251.73	0.05	16,644.00 PROSUS NV	898,276.68	0.61
430.00 REPLY SPA	46,268.00	0.03	4,327.00 QIAGEN REGD EUR	185,974.46	0.13
39,223.00 SNAM SPA	162,618.56	0.11	2,316.00 RANDSTAD BR	103,247.28	0.07
188,825.00 TELECOM ITALIA	35,933.40	0.02	16,895.00 ROYAL PHILIPS NV	270,320.00	0.19
27,169.00 TERNA SPA	169,806.25	0.12	2,539.00 SIGNIFY NV	67,613.57	0.05
37,025.00 UNICREDIT SPA REGS	387,207.45	0.27	43,801.00 STELLANTIS N.V.-BEARER & REGISTERED SHS	537,525.87	0.37
Luxembourg	643,260.88	0.44	12,125.00 STMICROELECTRONICS	391,031.25	0.27
13,345.00 ARCELORMITTAL SA	275,774.43	0.19	4,836.00 WOLTERS KLUWER NV	483,213.12	0.33
17,408.00 AROUNDTOWN SA	39,289.86	0.03	Pologne	81,041.39	0.06
2,490.00 EUROFINS SCIENTIFIC SE	152,188.80	0.10	19.00 LPP	30,609.69	0.02
2,251.00 MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA-SDR-	26,554.46	0.02	10,536.00 POWSZECHNY ZAKLAD UBEZPIECZEN	50,431.70	0.04
2,554.00 SOFTCAT PLC	34,631.49	0.02	Portugal	179,270.14	0.12
8,656.00 TENARIS SA - REG.SHS	114,821.84	0.08	7,837.00 GALP ENERGIA SA REG SHS -B-	76,990.69	0.05
Malte	20,452.47	0.01	5,369.00 JERONIMO MARTINS SGPS SA	102,279.45	0.07
2,654.00 KINDRED GROUP SWEDISH DEP REC	20,452.47	0.01	Royaume-Uni	32,434,754.69	22.26
Norvège	1,943,228.98	1.33	47,363.00 ABRDN PLC	75,070.57	0.05
5,762.00 AKER BP SHS	168,722.89	0.12	26,279.00 ANGLO AMERICAN PLC	819,122.66	0.56
16,993.00 DNB BK ASA	275,138.41	0.19	13,807.00 ANTOFAGASTA PLC	175,498.05	0.12
20,308.00 EQUINOR ASA	681,213.51	0.46	8,830.00 ASHTREAD GROUP	411,114.18	0.28
3,672.00 GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	64,321.48	0.04	7,426.00 ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	106,744.52	0.07
8,646.00 MOWI ASA	112,170.02	0.08	56,247.00 ASSURA PLC	34,353.22	0.02
2,899.00 NORDIC VLSI	39,511.45	0.03	29,572.00 ASTRAZENECA PLC	3,350,774.48	2.30
38,963.00 NORSK HYDRO ASA	214,751.81	0.15	19,726.00 AUTO TRADER GROUP PLC	115,757.63	0.08
14,611.00 ORKLA ASA	108,396.91	0.07	55,644.00 AVIVA PLC	246,137.20	0.17
1,100.00 SALMAR	37,836.17	0.03	12,153.00 BALFOUR BEATTY	42,430.25	0.03
			292,846.00 BARCLAYS PLC	481,514.10	0.33

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets		
	EUR			EUR			
21,361.00	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	83,292.32	0.06	17,794.00	ROYAL MAIL	37,398.62	0.03
13,314.00	BEAZLEY PLC	85,563.99	0.06	10,114.00	RS GRP --- REGISTERED SHS	111,673.50	0.08
2,288.00	BELLWAY PLC	44,399.09	0.03	19,730.00	SCHRODERS PLC	87,521.52	0.06
4,252.00	BIG YELLOW GROUP PLC	51,357.34	0.04	23,590.00	SEGRO (REIT)	202,407.36	0.14
361,233.00	BP PLC	1,782,702.96	1.22	4,807.00	SEVERN TRENT PLC	128,993.68	0.09
18,767.00	BRITISH LAND CO PLC REIT	74,995.29	0.05	138,248.00	SHELL PLC	3,543,987.48	2.44
5,283.00	BRITVIC PLC	43,192.26	0.03	17,594.00	SMITH AND NEPHEW PLC	210,602.75	0.14
140,438.00	BT GROUP PLC	194,190.42	0.13	7,577.00	SMITHS GROUP -SHS-	130,369.99	0.09
6,808.00	BUNZL PLC	214,107.57	0.15	2,527.00	SPECTRIS	78,781.59	0.05
7,462.00	BURBERRY GROUP PLC	153,729.44	0.11	1,504.00	SPIRAX-SARCO ENGINE	178,231.54	0.12
126,684.00	CENTRICA	102,259.51	0.07	21,549.00	SSE PLC	375,069.48	0.26
34,496.00	COMPASS GROUP	709,494.99	0.49	9,452.00	ST JAMES PLACE CAPITAL	111,580.13	0.08
1,506.00	COMPUTACENTER	33,171.13	0.02	48,745.00	STANDARD CHARTERED PLC	314,820.72	0.22
36,052.00	CONVATEC GROUP REGD	84,460.93	0.06	9,045.00	TATE & LYLE PLC NPV	70,084.32	0.05
2,873.00	CRODA INTL - REGISTERED SHS	211,022.77	0.14	78,263.00	TAYLOR WIMPEY PLC	78,744.56	0.05
2,354.00	DECHARA PHARMACTLS PLC	70,330.31	0.05	146,792.00	TESCO --- REGISTERED SHS	345,904.58	0.24
2,388.00	DERWENT LONDON PLC	54,965.36	0.04	2,078.00	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	78,067.07	0.05
43,623.00	DIAGEO PLC	1,887,629.25	1.30	5,140.00	TRAVIS PERKINS PLC	45,472.84	0.03
2,827.00	DIPLOMA	74,862.67	0.05	42,138.00	TRITAX BIG BOX REIT PLC	65,204.42	0.04
28,282.00	DIRECT LINE INS GR PLC NI	59,780.21	0.04	48,951.00	UNILEVER	2,213,839.10	1.52
29,631.00	DS SMITH HOLDING	86,738.88	0.06	7,303.00	UNITE GROUP PLC	71,440.59	0.05
1,889.00	GREGGS PLC	36,850.14	0.03	14,126.00	UNITED UTILITIES GROUP PLC	143,062.78	0.10
78,215.00	GSK --- REGISTERED SHS	1,163,777.88	0.80	30,640.00	VIRGIN MONEY UK PLC	43,397.36	0.03
7,745.00	HALMA PLC	180,475.44	0.12	3,620.00	VISTRY GROUP PLC	27,658.03	0.02
3,829.00	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	59,490.00	0.04	505,043.00	VODAFONE GROUP PLC	581,927.39	0.40
12,883.00	HOWDEN JOINERY GROUP	74,162.40	0.05	4,554.00	WATCH SWITZ GRP - REGISTERED SHS	34,974.89	0.02
388,013.00	HSBC HOLDINGS PLC	2,066,071.95	1.42	5,563.00	WEIR GROUP PLC	89,156.34	0.06
6,294.00	ICG(OST)	70,484.77	0.05	4,241.00	WHITBREAD	111,244.10	0.08
5,785.00	IMI	73,762.71	0.05	18,060.00	3I GROUP PLC	224,926.85	0.15
29,382.00	INFORMA PLC	173,827.87	0.12		Suède	7,134,961.40	4.90
3,788.00	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	188,579.90	0.13	2,362.00	AAK --- REGISTERED SHS	32,013.60	0.02
3,269.00	INTERTEK GROUP PLC	138,083.22	0.09	3,835.00	ADDTECH - REGISTERED SHS -B-	51,995.70	0.04
14,531.00	INVESTEC	60,120.85	0.04	5,583.00	ALFA LAVAL	142,968.84	0.10
67,241.00	ITV PLC	43,887.47	0.03	18,857.00	ASSA ABLOY -B- NEW I	363,727.02	0.25
37,997.00	J SAINSBURY PLC	75,465.78	0.05	50,055.00	ATLAS COPCO AB	482,517.74	0.34
54,915.00	JD SPORTS FASHION PLC	62,699.21	0.04	2,061.00	AXFOOD AB	48,322.83	0.03
4,023.00	JOHNSON MATTHEY	84,003.51	0.06	11,091.00	BILLERUDKORSNAS AB	134,051.16	0.09
42,726.00	KINGFISHER PLC	107,301.85	0.07	3,133.00	BIOVITRUM AB	62,131.76	0.04
14,612.00	LAND SEC R.E.I.T	86,879.47	0.06	7,471.00	BOLIDEN --- REGISTERED SHS	238,149.23	0.16
116,530.00	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	287,474.30	0.20	4,213.00	CASTELLUM AB	48,498.34	0.03
1,320,333.00	LLOYDS BANKING GROUP PLC	622,704.91	0.43	3,024.00	ELECTROLUX AB	32,327.13	0.02
22,698.00	LONDONMETRIC PROPERTY PLC	45,132.19	0.03	4,840.00	ELEKTA INSTRUMENT -B- FREE	25,313.77	0.02
6,860.00	LSE GROUP	596,263.45	0.41	11,964.00	EPIROC --- REGISTERED SHS -A-	176,241.38	0.12
53,264.00	M AND G REGISTERED SHS	101,083.85	0.07	13,028.00	EQT AB	262,557.64	0.18
36,315.00	MARKS AND SPENCER GROUP PLC	40,833.68	0.03	10,976.00	ESSITY AB REGISTERED -B-	222,919.32	0.15
9,469.00	MONDI PLC	150,407.77	0.10	4,776.00	FABEGE --REGISTERED SHS	33,343.46	0.02
70,608.00	NATIONAL GRID PLC	749,043.39	0.51	10,458.00	FASTIGHETS-B SHS SHARES	43,052.14	0.03
14,169.00	NATWEST GROUP PLC	244,536.24	0.17	3,766.00	GETINGE -B-	66,405.95	0.05
2,645.00	NEXT PLC	144,697.41	0.10	13,903.00	HENNES AND MAURITZ AB	132,307.82	0.09
14,039.00	PEARSON PLC	138,662.32	0.10	40,482.00	HEXAGON --- REGISTERED SHS -B-	389,864.04	0.27
4,925.00	PENNON GROUP --- REGISTERED SHS	44,165.62	0.03	3,667.00	HOLMEN -REGISTERED SHS	143,183.56	0.10
18,021.00	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC - REG SHS	108,175.28	0.07	5,423.00	HUSQVARNA -B-	30,976.74	0.02
53,391.00	PRUDENTIAL PLC	543,765.68	0.37	2,987.00	INDUSTRIVAERDEN -C- FREE	61,351.97	0.04
14,169.00	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	964,835.28	0.66	4,466.00	INDUTRADE AB	74,928.68	0.05
37,864.00	RELX PLC	950,051.60	0.65	34,507.00	INVESTOR --- REGISTERED SHS -B-	519,208.68	0.37
37,491.00	RENTOKIL INITIAL PLC	203,987.61	0.14	3,705.00	KINNEVIK AB	50,301.29	0.03
20,873.00	ROTORK NEW ISSUE	55,702.56	0.04				

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets			
	EUR			EUR				
29,233.00	NIBE INDUSTRIER	269,160.91	0.18	1,463.00	SWISS PRIME SITE AG-NAMEN AKT	119,868.28	0.08	
18,601.00	SAMHALLSBYGGNAD	20,813.88	0.01	5,314.00	SWISS RE REGS	403,207.05	0.28	
20,656.00	SANDVIK AB	289,843.11	0.20	474.00	SWISSCOM SHS NOM	227,856.25	0.16	
7,643.00	SECURITAS -B- FREE	54,554.44	0.04	246.00	TECAN GROUP NAM.AKT	87,510.89	0.06	
31,736.00	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN -A-	311,765.44	0.21	1,150.00	TEMENOS AG NAM.AKT	80,435.60	0.06	
6,947.00	SKANSKA -B- FREE	89,140.70	0.06	61,818.00	UBS GROUP SA	928,039.36	0.64	
12,535.00	SKF AB -B-	173,238.07	0.12	2,891.00	ZURICH INSURANCE GROUP NAMENSAKT	1,184,344.53	0.81	
29,624.00	SSAB - REGISTERED -B-	130,358.52	0.09		Warrants, Droits	13,019.95	0.01	
15,699.00	SVENSKA CELLULOSA SCA AB-SHS-B-	205,052.41	0.14		Suède	13,019.95	0.01	
27,771.00	SVENSKA HANDELSBANKEN AB-A-	234,037.99	0.16	30,572.00	SECURITAS AB 11.10.22 RIGHT	13,019.95	0.01	
2,735.00	SWECO AB	23,547.12	0.02		Autres valeurs mobilières	60,150.07	0.04	
16,708.00	SWEDBANK -A-	225,685.14	0.15		Actions	60,150.07	0.04	
59,703.00	TELEFON ERICSSON	359,646.37	0.25		Royaume-Uni	60,150.07	0.04	
9,262.00	TELE2 AB	81,786.30	0.06		1,330.00	CFD UNILEVER - REGISTERED SHS	60,150.07	0.04
43,502.00	TELIA COMPANY AB	128,165.37	0.09		Total portefeuille-titres	144,727,171.07	99.37	
1,257.00	THULE CORP	25,841.48	0.02					
4,615.00	TRELLEBORG -B- FREE	89,102.25	0.06					
672.00	VIAPLAY GRP - REGISTERED SHS -B-	13,536.86	0.01					
954.00	VITROLIFE -REGISTERED SHS	13,952.43	0.01					
29,837.00	VOLVO AB -B-	433,847.02	0.30					
8,122.00	VOLVO CAR AB	36,405.24	0.02					
7,442.00	WALLENSTAM BYGGNADS AB	27,778.34	0.02					
4,688.00	WIHLBORGS FASTIGHETER AB.	29,042.22	0.02					
	Suisse	24,773,943.55	17.01					
30,448.00	ABB LTD REG SHS	814,725.57	0.56					
2,703.00	ADECCO REG.SHS	76,840.10	0.05					
9,271.00	ALCON - REGISTERED SHS	559,029.18	0.38					
767.00	BALOISE HOLDING REG.SHS	100,787.08	0.07					
60.00	BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	116,303.68	0.08					
151.00	BELIMO HOLDING LTD	57,552.89	0.04					
19.00	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP PARTIZIPSCH	188,384.15	0.13					
10,051.00	CIE FINANCIERE RICHEMONT NAMEN AKT	982,792.24	0.67					
4,335.00	CLARIANT NAMEN AKT	71,485.69	0.05					
4,540.00	COCA COLA HBC NAMEN	97,980.40	0.07					
46,590.00	CREDIT SUISSE GROUP AG REG SHS	192,119.73	0.13					
470.00	DKSH HOLDING SA	34,998.96	0.02					
683.00	GEBERIT AG	302,823.58	0.21					
1,264.00	GEORG FISCHER LTD	62,400.33	0.04					
147.00	GIVAUDAN SA REG.SHS	457,831.36	0.31					
522.00	HELVETIA HLDG - REGISTERED SHS	50,294.33	0.03					
10,395.00	HOLCIM LTD	441,803.67	0.30					
4,361.00	JULIUS BAER GROUP NAMEN AKT	196,747.04	0.14					
1,073.00	KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG	224,793.61	0.15					
3,215.00	LOGITECH NAMEN AKT	153,214.32	0.11					
1,385.00	LONZA GROUP (CHF)	698,532.98	0.48					
52,394.00	NESTLE SA REG SHS	5,818,657.46	3.99					
43,225.00	NOVARTIS AG REG SHS	3,386,003.16	2.32					
415.00	PARTNERS GROUP HLDG NAMEN AKT	346,306.78	0.24					
13,395.00	ROCHE HOLDING LTD	4,493,479.31	3.09					
755.00	SCHINDLER HOLDING SA	121,095.99	0.08					
118.00	SGS SA REG SHS	260,060.16	0.18					
5,948.00	SIG GROUP --- REGISTERED SHS	124,487.29	0.09					
2,851.00	SIKA - REGISTERED SHS	593,440.88	0.41					
1,004.00	SONOVA HOLDING NAM-AKT	229,081.10	0.16					
2,227.00	STRAUMANN HOLDING LTD	212,121.63	0.15					
608.00	SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	276,506.94	0.19					

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	1,695,018,305.13	99.63	58,542.00 VERBUND AG	5,119,497.90	0.30
Actions	1,694,942,972.37	99.63	143,433.00 VOESTALPINE AG	2,511,511.83	0.15
Allemagne	169,309,853.05	9.95	Belgique	23,145,192.42	1.36
43,239.00 ADIDAS AG NAMEN AKT	5,140,252.32	0.30	10,584.00 AGEAS NOM	396,264.96	0.02
165,945.00 ALLIANZ SE REG SHS	26,849,901.00	1.59	139,842.00 ANHEUSER-BUSCH INBEV	6,536,914.29	0.39
10,563.00 BECHTLE	392,204.19	0.02	6,547.00 D'IETERN	951,279.10	0.06
6,311.00 BEIERSDORF AG	637,095.45	0.04	2,749.00 ELIA SYSTEM OPERATOR SA	330,979.60	0.02
39,331.00 BMW AG	2,752,776.69	0.16	5,889.00 GROUPE BRUXELLES LAMBERT GBL	423,301.32	0.02
38,188.00 BMW VORZUG - STIMMRECHTSLOS	2,554,777.20	0.15	158,484.00 KBC GROUPE SA	7,711,831.44	0.46
9,953.00 BRENNTAG - NAMEN AKT	620,868.14	0.04	37,120.00 PROXIMUS SA	393,286.41	0.02
3,764.00 CARL ZEISS MEDITEC AG	404,441.80	0.02	2,384.00 SOFINA SA	423,160.00	0.02
201,733.00 COMMERZBK	1,481,123.69	0.09	4,985.00 SOLVAY	397,005.40	0.02
8,104.00 CONTINENTAL AG	372,378.80	0.02	8,032.00 UCB	571,235.84	0.03
14,137.00 COVESTRO AG	417,606.98	0.02	153,142.00 UMICORE SA	4,614,168.46	0.28
28,850.00 DAIMLER TRUCK HOLDING AG	673,647.50	0.04	15,755.00 WAREHOUSES DE PAUW SCA - REGISTERED SHS	395,765.60	0.02
10,516.00 DELIVERY HERO	398,977.04	0.02	Danemark	76,048,477.90	4.47
119,646.00 DEUTSCHE BANK AG REG SHS	914,813.32	0.05	1,917.00 A.P. MOELLER-MAERSK A/S -B-	3,574,659.91	0.21
69,870.00 DEUTSCHE BOERSE AG REG SHS	11,755,627.50	0.69	2,177.00 A.P. MOELLER-MAERSK -A-	3,946,763.14	0.23
79,631.00 DEUTSCHE LUFTHANSA AG REG SHS	471,256.26	0.03	25,060.00 CARLSBERG AS -B-	3,012,410.55	0.18
59,436.00 DEUTSCHE POST AG REG SHS	1,849,351.14	0.11	8,335.00 CHRISTIAN HANSEN	420,143.77	0.02
198,349.00 DEUTSCHE TELEKOM AG REG SHS	3,469,520.71	0.20	7,490.00 COLOPLAST -B-	781,491.64	0.05
506,195.00 E.ON SE	3,996,915.72	0.23	37,658.00 DANSKE BANK	480,332.02	0.03
25,144.00 EVONIK INDUSTRIES	433,734.00	0.03	12,457.00 DEMANT A/S	316,557.86	0.02
14,429.00 FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA	418,873.87	0.02	12,060.00 DSV A/S	1,453,275.86	0.09
27,840.00 FRESENIUS SE	611,088.00	0.04	3,953.00 GENMAB AS	1,308,371.79	0.08
56,347.00 GEA GROUP AG	1,878,608.98	0.11	15,118.00 GN GREAT NORDIC	272,656.50	0.02
3,831.00 HANNOVER RUECK SE	590,740.20	0.03	443,996.00 NOVO NORDISK	45,465,782.76	2.66
46,800.00 HEIDELBERGCEMENT AG	1,911,780.00	0.11	36,731.00 NOVOZYMES -B-	1,893,001.66	0.11
36,736.00 HELLOFRESH SE	799,008.00	0.05	49,964.00 ORSTED	4,082,218.29	0.24
7,698.00 HENKEL AG & CO KGAA	448,793.40	0.03	40,965.00 PANDORA	1,978,431.90	0.12
12,581.00 HENKEL AG & CO KGAA	767,692.62	0.05	1,779.00 ROCKWOOL SHS -B-	287,828.84	0.02
372,051.00 INFINEON TECHNOLOGIES REG SHS	8,449,278.21	0.50	22,875.00 TRYG A/S	482,699.43	0.03
12,161.00 KION GROUP AG	240,970.22	0.01	330,340.00 VESTAS WIND SYSTEMS - BEARER AND/OR SHS	6,291,851.98	0.36
8,643.00 KNORR-BREMSE - BEARER SHS	383,576.34	0.02	Espagne	71,842,132.36	4.22
4,861.00 LEG IMMOBILIEN - NAMEN AKT	298,270.96	0.02	2,417.00 ACCIONA SA	436,510.20	0.03
104,073.00 MERCK KGAA	17,359,376.40	1.02	21,787.00 ACS	503,933.31	0.03
66,955.00 MTU AERO ENGINES HOLDING AG	10,327,808.75	0.61	4,320.00 AENA SME SA	461,808.00	0.03
48,603.00 MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS AG REG SHS	12,029,242.50	0.71	29,023.00 AMADEUS IT GROUP SA -A-	1,390,491.93	0.08
6,914.00 NEMETSCHKE	340,376.22	0.02	3,051,911.00 BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA	14,101,354.78	0.83
131,899.00 PUMA AG	6,327,195.03	0.37	1,100,402.00 BANCO SANTANDER SA REG SHS	2,638,213.80	0.16
766.00 RATIONAL NAMEN	383,383.00	0.02	274,203.00 CAIXABANK SA	907,886.14	0.05
313,849.00 SAP AG	26,400,977.88	1.55	34,527.00 CELLNEX TELECOM SA	1,097,613.33	0.06
1,759.00 SARTORIUS VORZ.OHNE STIMMRECHT	628,138.90	0.04	15,438.00 EDP RENOVAVEIS SA	324,815.52	0.02
8,814.00 SCOUT24	455,860.08	0.03	316,245.00 ENAGAS	5,009,320.80	0.29
83,717.00 SIEMENS AG REG	8,472,160.40	0.50	111,267.00 ENDESA	1,715,737.14	0.10
34,060.00 SIEMENS ENERGY - REGISTERED SHS	387,773.10	0.02	30,218.00 FERROVIAL SA	706,799.02	0.04
18,673.00 SIEMENS HEALTHINEERS	826,840.44	0.05	30,949.00 GAMESA CORPORACION TECNOLOGICA SA	554,760.83	0.03
9,185.00 SYMRISE AG	922,633.25	0.05	37,935.00 GRIFOLS SA -A-	336,938.67	0.02
187,827.00 TELEFONICA NAMEN AKT	389,365.37	0.02	2,314,887.00 IBERDROLA SA	22,181,247.23	1.30
16,938.00 UNITED INTERNET AG REG SHS	326,225.88	0.02	372,097.00 INDITEX SHARE FROM SPLIT	7,918,224.16	0.47
43,462.00 VONOVIA SE	965,291.02	0.06	182,239.00 NATURGY ENERGY GROUP SA	4,324,531.47	0.25
18,846.00 ZALANDO SE	381,254.58	0.02	385,259.00 RED ELECTRICA	6,052,418.89	0.36
Autriche	8,209,891.89	0.48	349,386.00 TELEFONICA SA	1,179,527.14	0.07
25,569.00 ERSTE GROUP BANK AG	578,882.16	0.03			

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Finlande	46,257,880.59	2.72			
9,038.00 ELISA CORPORATION -A-	418,911.30	0.02	1,757.00 SARTORIUS STEDIM BIOTECH	557,144.70	0.03
325,703.00 KESKO CORP	6,235,583.94	0.37	250,890.00 SCHNEIDER ELECTRIC SE	29,339,076.60	1.73
21,818.00 KONE OYJ -B-	864,210.98	0.05	6,417.00 SEB SA	415,179.90	0.02
444,999.00 NESTE	19,935,955.20	1.18	637,370.00 SOCIETE GENERALE SA	13,011,908.55	0.76
1,196,016.00 NOKIA OYJ	5,286,988.73	0.31	6,197.00 SODEXO SA	478,160.52	0.03
212,929.00 NORDEA BANK	1,873,765.02	0.11	3,732.00 TELEPERFORMANCE SE	973,678.80	0.06
9,825.00 ORION CORPORATION (NEW) -B-	423,261.00	0.02	11,400.00 UBISOFT ENTERTAINMENT	322,848.00	0.02
28,050.00 SAMPO OYJ -A-	1,227,468.00	0.07	76,428.00 UNIBAIL RODAMCO	3,277,614.78	0.19
202,236.00 STORA ENSO -R-	2,647,269.24	0.16	234,944.00 VALEO SA	3,672,174.72	0.22
120,585.00 UPM KYMMENE CORP	3,928,659.30	0.23	33,430.00 VINCI SA	2,780,373.10	0.16
518,962.00 WARTSILA CORPORATION -B-	3,415,807.88	0.20	55,834.00 VIVENDI SA	445,108.64	0.03
			5,970.00 WENDEL SA	440,884.50	0.03
			15,381.00 WORLDLINE SA	625,699.08	0.04
France	258,142,735.75	15.17			
19,775.00 ACCOR SA	427,337.75	0.03	Ile de Jersey	17,046,338.00	1.00
3,572.00 AEROPORTS DE PARIS-ADP-	425,068.00	0.02	58,116.00 EXPERIAN GROUP	1,762,154.47	0.10
33,482.00 AIR LIQUIDE SA	3,936,143.92	0.23	137,024.00 FERGUSON NEWCO PLC	14,682,927.26	0.86
977.00 ALSTOM	16,359.87	0.00	70,355.00 WPP PLC	601,256.27	0.04
23,411.00 ALSTOM SA	392,017.20	0.02			
8,188.00 AMUNDI SA	351,756.48	0.02	Ile de Man	2,245,963.33	0.13
5,714.00 ARKEMA SA	429,007.12	0.03	181,497.00 ENTAIN PLC	2,245,963.33	0.13
795,936.00 AXA SA	17,888,661.60	1.05			
18,146.00 BIOMERIEUX SA	1,477,084.40	0.09	Irlande	36,327,650.93	2.14
263,524.00 BNP PARIBAS SA	11,490,964.02	0.68	621,899.00 CRH PLC	20,566,199.93	1.20
105,712.00 BOLLORE --- ACT	499,172.06	0.03	8,237.00 DCC PLC	440,101.33	0.03
108,321.00 BOUYGUES SA	2,908,418.85	0.17	10,601.00 FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	1,197,913.00	0.07
21,257.00 BUREAU VERITAS SA	488,485.86	0.03	139,146.00 KERRY GROUP -A-	12,690,115.20	0.75
10,618.00 CAPGEMINI SE	1,757,279.00	0.10	9,947.00 KINGSPAN GROUP	460,943.98	0.03
39,435.00 CARREFOUR SA	560,568.53	0.03	33,153.00 SMURFIT KAPPA PLC	972,377.49	0.06
33,051.00 CIE DE SAINT-GOBAIN	1,224,539.55	0.07			
769,803.00 CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN	17,824,788.47	1.05	Italie	41,756,048.43	2.45
60,087.00 COVIVIO SA	2,975,508.24	0.17	35,118.00 AMPLIFON SPA	944,674.20	0.06
78,388.00 CREDIT AGRICOLE SA	655,637.23	0.04	71,550.00 ASSICURAZIONI GENERALI SPA	1,003,131.00	0.06
350,467.00 DANONE SA	17,022,182.19	1.00	31,920.00 ATLANTIA SPA	721,711.20	0.04
91,206.00 DASSAULT SYST.	3,259,246.41	0.19	3,716.00 DIASORIN	426,596.80	0.03
16,079.00 EDENRED SA	761,501.44	0.04	3,475,705.00 ENEL SPA	14,681,377.92	0.86
5,111.00 EDF ACT PRIME DE FIDELITE	60,769.79	0.00	44,092.00 FINECOBANK	561,511.62	0.03
36,711.00 EDF SA	436,493.79	0.03	49,950.00 INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE SPA	448,051.50	0.03
93,058.00 EIFFAGE	7,679,146.16	0.45	10,106,788.00 INTESA SANPAOLO	17,209,838.61	1.00
209,656.00 ENGIE --- REGISTERED LOYALTY BONUS	2,482,746.35	0.15	60,509.00 MEDIUMBANCA	487,702.54	0.03
74,406.00 ESSILORLUXOTTICA SA	10,442,882.10	0.61	13,460.00 MONCLER SPA	570,569.40	0.03
7,987.00 EURAZEO	430,099.95	0.03	49,384.00 NEXI SPA	411,961.33	0.02
58,377.00 GECINA	4,696,429.65	0.28	61,158.00 POSTE ITALIANE SPA	476,420.82	0.03
218,913.00 GETLINK ACT	3,481,811.27	0.20	16,411.00 PRYSMIAN SPA	486,093.82	0.03
2,047.00 HERMES INTERNATIONAL SA	2,491,199.00	0.15	11,585.00 RECORDATI SPA	436,638.65	0.03
5,439.00 IPSEN	516,161.10	0.03	128,111.00 SNAM SPA	531,148.21	0.03
27,393.00 KERING	12,561,060.15	0.74	2,318,525.00 TELECOM ITALIA	441,215.30	0.03
273,368.00 KLEPIERRE SA	4,893,287.20	0.29	81,968.00 TERNA SPA	512,300.00	0.03
12,829.00 LA FRANCAISE DES JEUX SA	390,899.63	0.02	134,357.00 UNICREDIT SPA REGS	1,405,105.51	0.08
17,964.00 LEGRAND SA	1,197,480.24	0.07			
75,689.00 L'OREAL SA	24,996,292.25	1.47	Luxembourg	9,342,865.19	0.55
27,524.00 LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	16,800,649.60	0.99	33,931.00 ARCELORMITTAL SA	701,184.12	0.04
128,528.00 ORANGE	1,188,626.94	0.07	128,039.00 AROUNDTOWN SA	288,984.02	0.02
63,128.00 PERNOD RICARD SA	11,921,722.80	0.70	8,246.00 EUROFINS SCIENTIFIC SE	503,995.52	0.03
14,696.00 PUBLICIS GROUPE	718,634.40	0.04	591,685.00 TENARIS SA - REG.SHS	7,848,701.53	0.46
4,469.00 REMY COINTREAU	763,752.10	0.04			
87,768.00 SANOFI	6,881,011.20	0.40	Norvège	50,658,374.15	2.98
			50,672.00 ADEVINTA ASA - REGISTERED SHS	308,527.00	0.02
			395,962.00 AKER BP SHS	11,594,559.62	0.69

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets		
	EUR			EUR			
728,307.00	DNB BK ASA	11,792,221.91	0.70	1,299,273.00	BARRATT DEVELOPMENTS PLC	5,066,217.19	0.30
22,767.00	GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	398,803.71	0.02	1,118,776.00	BRITISH LAND CO PLC REIT	4,470,769.63	0.26
225,368.00	MOWI ASA	2,923,841.32	0.17	1,820,530.00	BT GROUP PLC	2,517,334.96	0.15
1,417,060.00	NORSK HYDRO ASA	7,810,389.25	0.46	85,905.00	BUNZL PLC	2,701,661.35	0.16
941,095.00	ORKLA ASA	6,981,848.54	0.41	400,327.00	BURBERRY GROUP PLC	8,247,393.07	0.48
6,579.00	SALMAR	226,294.67	0.01	185,651.00	COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS	8,076,808.68	0.47
883,136.00	TELENOR ASA	8,244,422.63	0.48	115,241.00	COMPASS GROUP	2,370,214.28	0.14
10,513.00	YARA INTERNATIONAL ASA	377,465.50	0.02	154,422.00	CRODA INTL - REGISTERED SHS	11,342,345.17	0.67
	Pays-Bas	138,226,569.35	8.12	988,658.00	DIAGEO PLC	42,780,637.59	2.50
52,219.00	ABN AMRO GROUP DEP RECEIPT	481,876.93	0.03	710,129.00	GSK --- REGISTERED SHS	10,566,162.81	0.62
1,319.00	ADYEN --- PARTS SOCIALES	1,717,074.20	0.10	27,446.00	HALMA PLC	639,551.85	0.04
115,342.00	AEGON NV	473,132.88	0.03	44,021.00	HARGREAVES LANS - REGISTERED SHS	434,993.29	0.03
14,728.00	AERCAP HOLDINGS	636,386.71	0.04	29,660.00	HIKMA PHARMACEUTICALS PLC	460,818.25	0.03
163,160.00	AKZO NOBEL NV	9,515,491.20	0.56	4,446,725.00	HSBC HOLDINGS PLC	23,677,695.91	1.39
3,201.00	ARGENX SE	1,179,568.50	0.07	362,277.00	INFORMA PLC	2,143,279.60	0.13
2,975.00	ASM INTERNATIONAL NV	695,406.25	0.04	39,797.00	INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	1,981,233.96	0.12
116,792.00	ASML HOLDING NV	50,641,011.20	2.97	49,050.00	INTERTEK GROUP PLC	2,071,881.84	0.12
617,891.00	CNH INDUSTRIAL NV	7,186,072.33	0.42	2,223,180.00	J SAINSBURY PLC	4,415,454.35	0.26
45,612.00	DAVIDE CAMPARI-MILANO N.V.	415,616.54	0.02	304,472.00	JD SPORTS FASHION PLC	347,630.97	0.02
98,106.00	DSM KONINKLIJKE	11,522,549.70	0.67	168,109.00	JOHNSON MATTHEY	3,510,252.31	0.21
5,738.00	EURONEXT NV	373,543.80	0.02	1,190,561.00	KINGFISHER PLC	2,989,968.60	0.18
6,890.00	EXOR REG	427,869.00	0.03	175,446.00	LAND SEC R.E.I.T	1,043,160.02	0.06
7,897.00	FERRARI NV	1,513,854.90	0.09	5,350,073.00	LEGAL & GENERAL GROUP PLC	13,198,391.12	0.78
5,527.00	HEINEKEN HOLDING	389,653.50	0.02	12,105,023.00	LLOYDS BANKING GROUP PLC	5,709,057.68	0.34
16,699.00	HEINEKEN NV	1,500,572.14	0.09	46,418.00	LSE GROUP	4,034,600.09	0.24
3,793.00	IMCD	465,021.80	0.03	204,813.00	M AND G REGISTERED SHS	388,691.95	0.02
654,959.00	ING GROUP NV	5,801,626.82	0.34	578,317.00	MONDI PLC	9,186,120.08	0.54
15,918.00	JDE PEET S BV	476,584.92	0.03	1,850,317.00	NATIONAL GRID PLC	19,629,046.57	1.15
22,212.00	JUST EAT TAKEAWAY.COM N.V	359,301.31	0.02	1,876,995.00	NATWEST GROUP PLC	4,831,508.33	0.28
140,151.00	KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	3,662,846.39	0.22	8,404.00	NEXT PLC	459,749.36	0.03
2,942,542.00	KONINKLIJKE KPN NV	8,156,726.42	0.48	50,076.00	OCADO GROUP PLC	269,609.29	0.02
17,974.00	NN GROUP NV	718,420.78	0.04	48,527.00	PEARSON PLC	479,298.13	0.03
44,778.00	OCI REG.SHS	1,681,861.68	0.10	20,280.00	PERSIMMON PLC	285,967.41	0.02
194,328.00	PROSUS NV	10,487,882.16	0.62	59,972.00	PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC - REG SHS	359,996.01	0.02
14,250.00	QIAGEN REGD EUR	612,465.00	0.04	406,069.00	PRUDENTIAL PLC	4,135,648.04	0.24
8,739.00	RANDSTAD BR	389,584.62	0.02	115,339.00	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	7,853,986.60	0.46
56,155.00	ROYAL PHILIPS NV	898,480.00	0.05	709,716.00	RELX PLC	17,807,596.08	1.05
95,739.00	STMICROELECTRONICS	3,087,582.75	0.18	120,075.00	RENTOKIL INITIAL PLC	653,325.12	0.04
180,635.00	STMICROELECTRONICS NV	5,824,575.58	0.34	204,098.00	RIO TINTO PLC	11,386,324.16	0.67
42,457.00	UNIVERSAL MUSIC GROUP N.V.	820,523.98	0.05	615,143.00	SAGE GROUP	4,886,938.24	0.29
61,183.00	WOLTERS KLUWER NV	6,113,405.36	0.36	265,212.00	SCHRODERS PLC	1,176,470.28	0.07
	Portugal	6,429,918.75	0.38	1,114,165.00	SEGRO (REIT)	9,559,779.46	0.56
621,071.00	GALP ENERGIA SA REG SHS -B-	6,101,401.50	0.36	18,089.00	SEVERN TRENT PLC	485,410.15	0.03
17,245.00	JERONIMO MARTINS SGPS SA	328,517.25	0.02	55,728.00	SMITH AND NEPHEW PLC	667,072.29	0.04
	Royaume-Uni	366,286,436.72	21.54	26,791.00	SMITHS GROUP -SHS-	460,966.39	0.03
2,770,868.00	ABRDN PLC	4,391,838.41	0.26	4,677.00	SPIRAX-SARCO ENGIN	554,247.95	0.03
17,330.00	ADMIRAL GROUP PLC	378,057.03	0.02	582,969.00	SSE PLC	10,146,822.56	0.60
500,797.00	ANTOFAGASTA PLC	6,365,531.60	0.37	198,286.00	ST JAME'S PLACE CAPITAL	2,340,750.87	0.14
56,568.00	ASHTAD GROUP	2,633,738.01	0.15	472,848.00	STANDARD CHARTERED PLC	3,053,899.79	0.18
147,018.00	ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC	2,113,299.99	0.12	884,314.00	TAYLOR WIMPEY PLC	889,755.31	0.05
363,040.00	ASTRAZENECA PLC	41,135,708.29	2.41	60,835.00	THE BERKELEY GROUP HOLDINGS	2,285,471.68	0.13
69,337.00	AUTO TRADER GROUP PLC	406,888.73	0.02	270,921.00	UNILEVER	12,252,568.93	0.72
17,427.00	AVEVA GROUP	623,924.72	0.04	43,321.00	UNITED UTILITIES GROUP PLC	438,738.66	0.03
179,742.00	AVIVA PLC	795,075.71	0.05	1,737,729.00	VODAFONE GROUP PLC	2,002,269.33	0.12
3,470,067.00	BARCLAYS PLC	5,705,682.18	0.34	14,212.00	WHITBREAD	372,789.70	0.02
				613,305.00	3I GROUP PLC	7,638,358.76	0.45

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets		
Suède			EUR				
	74,461,061.24	4.38		EUR			
18,664.00	ALFA LAVAL	477,945.63	0.03	151,691.00	CREDIT SUISSE GROUP AG REG SHS	625,516.93	0.04
58,278.00	ASSA ABLOY -B- NEW I	1,124,106.88	0.07	575.00	EMS-CHEM HOLDINGS-NAMEN ACT.	374,805.54	0.02
159,115.00	ATLAS COPCO AB	1,533,829.00	0.09	7,073.00	GEBERIT AG	3,135,975.42	0.18
96,536.00	ATLAS COPCO AB	828,112.33	0.05	3,644.00	GIVAUDAN SA REG.SHS	11,349,234.60	0.67
21,993.00	BIOVITRUM AB	436,151.90	0.03	34,065.00	HOLCIM LTD	1,447,815.49	0.09
342,709.00	BOLIDEN --- REGISTERED SHS	10,924,358.67	0.63	14,055.00	JULIUS BAER GROUP NAMEN AKT	634,093.03	0.04
28,291.00	ELECTROLUX AB	302,436.15	0.02	43,607.00	KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG	9,135,671.03	0.54
58,982.00	EMBRACER GRP --- REGISTERED SHS	326,277.74	0.02	11,152.00	LOGITECH NAMEN AKT	531,460.70	0.03
42,456.00	EPIROC --- REGISTERED SHS -A-	625,418.26	0.04	40,535.00	LONZA GROUP (CHF)	20,444,068.14	1.20
34,389.00	EPIROC REGISTERED SHS -B-	446,008.56	0.03	550,219.00	NESTLE SA REG SHS	61,105,009.87	3.59
21,014.00	EQT AB	423,502.17	0.02	406,330.00	NOVARTIS AG REG SHS	31,829,604.75	1.87
211,420.00	ESSITY AB REGISTERED -B-	4,293,877.75	0.25	1,367.00	PARTNERS GROUP HLDG NAMEN AKT	1,140,726.20	0.07
11,654.00	EVOLUTION AB	950,616.26	0.06	5,183.00	ROCHE HOLDING AG	2,084,595.93	0.12
85,455.00	FASTIGHETS-B SHS SHARES	351,790.07	0.02	134,383.00	ROCHE HOLDING LTD	45,080,047.03	2.65
24,735.00	GETINGE -B-	436,152.70	0.03	3,004.00	SCHINDLER HOLDING NAMEN AKT	467,330.43	0.03
230,169.00	HENNES AND MAURITZ AB	2,190,402.08	0.13	3,055.00	SCHINDLER HOLDING SA	489,997.67	0.03
123,360.00	HEXAGON --- REGISTERED SHS -B-	1,188,025.01	0.07	7.00	SCHOKOLADENFABRIK LINDT SPRUENGLI	714,374.61	0.04
11,554.00	HOLMEN -REGISTERED SHS	451,143.39	0.03	1,301.00	SGS SA REG SHS	2,867,273.39	0.17
70,612.00	HUSQVARNA -B-	403,343.12	0.02	122,087.00	SIG GROUP --- REGISTERED SHS	2,555,191.52	0.15
22,894.00	INDUSTRIVAERDEN AB -A- FREE	475,289.01	0.03	9,734.00	SIKA - REGISTERED SHS	2,026,149.97	0.12
23,116.00	INDUSTRIVAERDEN -C- FREE	474,794.79	0.03	32,823.00	SONOVA HOLDING NAM-AKT	7,489,172.37	0.44
21,129.00	INDUTRADE AB	354,493.53	0.02	14,734.00	STRAUMANN HOLDING LTD	1,403,412.74	0.08
31,683.00	INVESTOR --- REGISTERED SHS -A-	499,944.23	0.03	2,031.00	SWISS LIFE HOLDING N-NAMEN REGISTERED	923,660.55	0.05
116,534.00	INVESTOR --- REGISTERED SHS -B-	1,753,425.80	0.10	4,390.00	SWISS PRIME SITE AG-NAMEN AKT	359,686.78	0.02
33,047.00	KINNEVIK AB	448,665.77	0.03	158,515.00	SWISS RE REGS	12,027,543.45	0.71
20,089.00	LATOUR INVESTMENT REGISTERED B	342,957.92	0.02	1,473.00	SWISSCOM SHS NOM	708,084.94	0.04
24,365.00	LIFCO AB	350,067.65	0.02	6,061.00	TEMENOS AG NAM.AKT	423,930.55	0.02
12,723.00	LUNDBERGFOERETAGEN -B- FREE	473,265.90	0.03	1,921.00	THE SWATCH GROUP	447,277.02	0.03
233,924.00	NIBE INDUSTRIER	2,153,839.80	0.13	12,104.00	THE SWATCH GROUP REG	524,230.49	0.03
22,013.00	SAGAX -B-	372,969.56	0.02	863,971.00	UBS GROUP SA	12,970,317.61	0.76
71,864.00	SANDVIK AB	1,008,389.09	0.06	1,996.00	VAT GROUP SA	421,888.40	0.02
24,310.00	SECURITAS -B- FREE	173,520.67	0.01	75,593.00	ZURICH INSURANCE GROUP NAMENSAKT	30,967,885.30	1.82
103,398.00	SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN -A-	1,015,752.57	0.06		Warrants, Droits	75,332.76	0.00
31,711.00	SKANSKA -B- FREE	406,900.93	0.02		France	0.00	0.00
31,334.00	SKF AB -B-	433,046.82	0.03	3,214.00	REMY COINTREAU 19/09/22 RIGHT	0.00	0.00
676,763.00	SVENSKA CELLULOSA SCA AB-SHS-B-	8,839,536.41	0.52		Suède	75,332.76	0.00
300,455.00	SVENSKA HANDELSBANKEN AB-A-	2,532,061.57	0.15	176,888.00	SECURITAS AB 11.10.22 RIGHT	75,332.76	0.00
53,361.00	SWEDBANK -A-	720,779.54	0.04		Autres valeurs mobilières	2,972.50	0.00
678,204.00	TELEFON ERICSSON	4,085,449.77	0.24		Actions	2,972.50	0.00
606,677.00	TELE2 AB	5,357,143.76	0.31		France	2,972.50	0.00
3,124,259.00	TELIA COMPANY AB	9,204,676.00	0.53	250.00	ELECTRICITE DE FRANCE PRIME FIDEL 2024	2,972.50	0.00
26,402.00	VOLVO -A- FREE	400,219.80	0.02		Warrants, Droits	0.00	0.00
317,187.00	VOLVO AB -B-	4,612,080.13	0.27		Pays-Bas	0.00	0.00
57,625.00	VOLVO CAR AB	258,292.55	0.02	200,840.00	PROSUS NV RTS	0.00	0.00
	Suisse	299,205,582.32	17.59		Total portefeuille-titres	1,695,021,277.63	99.63
480,773.00	ABB LTD REG SHS	12,864,492.23	0.76				
12,848.00	ADECCO REG.SHS	365,239.24	0.02				
29,960.00	ALCON - REGISTERED SHS	1,806,548.85	0.11				
6,320.00	BACHEM HOLDING LTD SHARES	411,632.44	0.02				
3,565.00	BALOISE HOLDING REG.SHS	468,456.23	0.03				
227.00	BARRY CALLEBAUT - NAMEN-AKT	440,015.56	0.03				
120.00	CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SP PARTIZIPSCHE	1,189,794.65	0.07				
105,543.00	CIE FINANCIERE RICHEMONT NAMEN AKT	10,320,051.90	0.61				
25,385.00	CLARIANT NAMEN AKT	418,607.65	0.02				
195,292.00	COCA COLA HBC NAMEN	4,214,711.12	0.25				

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	40,985,325.26	80.30	Belgique	505,217.46	0.99
Obligations	35,680,384.90	69.91	100,000.00 AEDIFICA NV 0.75 21-31 09/09A	65,316.70	0.13
Allemagne	3,679,220.50	7.21	100,000.00 BELFIUS BANQUE SA 0.375 19-26 13/02A	89,301.63	0.17
69,000.00 AMPHENOL TECHNO HOLDG 2.00 18-28 08/10A	62,440.30	0.12	100,000.00 BELFIUS BANQUE SA 3.125 16-26 11/05A	93,539.07	0.18
100,000.00 BERTELSMANN SE CO. 2.20-28 01/04A	92,364.80	0.18	100,000.00 ELIA SYSTEM 1.5 18-28 05/09A	88,769.86	0.17
100,000.00 BERTELSMANN SE 1.125 16-26 27/04A	94,295.18	0.18	100,000.00 ELIA SYSTEM OPERATOR 1.375 19-26 14/01A	93,721.79	0.19
100,000.00 COMMERZBANK AG 1.125 17-24 24/05A	95,805.70	0.19	100,000.00 SOLVAY SA 0.500 19-29 06/09A	74,568.41	0.15
100,000.00 COMMERZBANK AG 0.875 20-27 22/01A	84,724.26	0.17	Danemark	358,125.92	0.70
100,000.00 COMMERZBANK AG 1.25 18-23 23/10A	97,769.16	0.19	100,000.00 DANSKE BANK A/S 1.5 20-30 02/09A	87,405.92	0.17
100,000.00 CONTINENTAL AG 2.5 20-26 27/05A	95,770.45	0.19	100,000.00 H. LUNDBECK A/S 0.875 20-27 14/10A	84,538.38	0.17
101,000.00 COVESTRO AG 1.75 16-24 25/09A	97,125.12	0.19	100,000.00 ISS GLOBAL A/S 0.875 19-26 18/06A	88,383.94	0.17
51,000.00 COVESTRO AG 0.875 20-26 12/06A	46,051.47	0.09	100,000.00 ISS GLOBAL A/S 2.125 14-24 02/12A	97,797.68	0.19
100,000.00 DEUTSCHE BANK AG 1.375 21-32 17/02A	70,181.04	0.14	Espagne	3,370,526.39	6.60
300,000.00 DEUTSCHE BANK AG 1.625 20-27 20/01A	255,395.19	0.49	100,000.00 ABERTIS INFRASTRUCT 1.00 16-27 27/02A	87,339.00	0.17
100,000.00 DEUTSCHE PFANDBRIEFB 0.25 22-25 17/01A	90,423.65	0.18	200,000.00 ABERTIS INFRASTRUCT 3.0000 19-31 27/03A	174,076.80	0.34
200,000.00 DEUTSCHE TELEKOM AG 0.50 19-27 05/07A	176,451.40	0.35	200,000.00 AMADEUS IT GROUP S.A 2.5 20-24 20/05A	198,190.32	0.39
21,000.00 DEUTSCHE TELEKOM AG 0.875 19-26 25/03A	19,535.05	0.04	100,000.00 BANCO BILBAO VIZCAYA 0.5 20-27 14/01A	85,520.31	0.17
51,000.00 DEUTSCHE TELEKOM AG 1.375 19-34 05/07A	39,563.46	0.08	100,000.00 BANCO BILBAO VIZCAYA 1.00 19-26 21/06A	90,259.68	0.18
50,000.00 DEUTSCHE TELEKOM AG 1.75 19-31 25/03A	43,585.93	0.09	100,000.00 BANCO BILBAO VIZCAYA 3.50 17-27 10/02A	94,246.70	0.18
50,000.00 DEUTSCHE TELEKOM AG 1.75 19-49 09/12A	32,192.85	0.06	100,000.00 BANCO SANTANDER SA 1.625 20-30 22/10A	73,172.84	0.14
200,000.00 DEUTSCHE WOHNEN SE 1 20-25 30/04A	187,622.98	0.36	100,000.00 BANCO SANTANDER SA 2.125 18-28 08/02A	85,217.19	0.17
100,000.00 EUROGRID GMBH 1.50 16-28 18/04A	88,829.18	0.17	500,000.00 BANCO SANTANDER SA 3.25 16-26 04/04A	473,128.85	0.93
100,000.00 EVONIK INDUSTRIES 2.25 22-27 25/09A	90,945.59	0.18	600,000.00 BANKINTER SA 0.8750 19-26 08/07A	522,384.42	1.03
100,000.00 FRESENIUS MEDICAL CA 1.5 20-30 29/05A	78,098.45	0.15	300,000.00 CAIXABANK S.A. 0.75 21-28 26/05A	246,969.96	0.48
100,000.00 FRESENIUS MEDICAL CARE 1.50 18-25 11/07A	94,827.62	0.19	100,000.00 CAIXABANK SA 2.375 19-24 01/02A	98,485.95	0.19
100,000.00 FRESENIUS SE & 1.8750 22-25 24/05A	95,734.48	0.19	100,000.00 ENAGAS FINANCIACIO 0.75 16-26 27/10S	89,321.51	0.17
100,000.00 FRESENIUS SE & 2.8750 22-30 24/05A	89,895.10	0.18	100,000.00 FERROVIAL EMISIONES 1.382 20-26 14/05A	92,787.46	0.18
53,000.00 FRESENIUS SE CO. KG 0.75 20-28 15/01A	45,166.09	0.09	100,000.00 INMOBILIARIA COLONIA 0.75 21-29 22/06A	76,599.79	0.15
14,000.00 FRESENIUS SE CO. KG 1.125 20-33 28/09A	9,846.81	0.02	100,000.00 MAPFRE 4.125 18-48 30/08A	88,187.60	0.17
1,000.00 FRESENIUS SE CO. KG 1.625 20-27 08/04A	897.91	0.00	100,000.00 MERLIN PROPERTIES 1.875 16-26 02/11A	90,259.86	0.18
184,000.00 HEIDELBERG CEMENT 1.50 16-25 07/02A	176,606.23	0.35	100,000.00 MERLIN PROPERTIES 1.875 19-34 04/12A	67,156.32	0.13
10,000.00 HEIDELBERGCEMENT 2.25 16-24 03/06A	9,852.43	0.02	100,000.00 TELEFONICA EMISIONES 0.664 20-30 03/02A	79,864.62	0.16
61,000.00 HOCHTIEF AG 0.5 19-27 03/09A	48,468.42	0.09	100,000.00 TELEFONICA EMISIONES 1.495 18-25 11/09A	95,559.29	0.19
109,000.00 HOCHTIEF AG 1.75 18-25 03/07A	102,478.32	0.20	100,000.00 TELEFONICA EMISIONES 1.807 20-32 21/05A	81,313.34	0.16
100,000.00 INFINEON TECHNO 1.625 20-29 24/06A	86,734.59	0.17	200,000.00 TELEFONICA EMISIONES 1.069 19-24 05/02A	196,103.28	0.38
100,000.00 LANDESBANK BADEN-WUER 2.2 19-29 09/05A	77,953.95	0.15	100,000.00 TELEFONICA EMISIONES 1.46 16-26 13/04A	93,654.40	0.18
100,000.00 LANXESS AG 0.625 21-29 01/12A	74,340.92	0.15	100,000.00 TELEFONICA EMISIONES 1.715 17-28 12/01A	90,726.90	0.18
100,000.00 LEG IMMOBILIEN SE 0.875 21-33 30/03A	63,592.66	0.12	Etats-Unis d'Amérique	4,908,221.25	9.62
100,000.00 VIER GAS TRANSPORT 1.5 18-28 25/09A	84,276.95	0.17	100,000.00 ABBVIE INC 0.75 19-27 18/11A	86,423.93	0.17
200,000.00 VONOVIA 0.75 21-32 01/09A	130,805.74	0.26	100,000.00 ABBVIE INC 1.375 16-24 17/05A	97,698.40	0.19
100,000.00 VONOVIA SE 0.0 21-25 01/12A	87,373.42	0.17	100,000.00 ABBVIE INC 2.625 20-28 15/11A	94,316.80	0.18
200,000.00 VONOVIA SE 1.625 21-51 01/09A	94,402.94	0.18	100,000.00 AMERICAN TOWER 0.45 21-27 21/05A	84,900.65	0.17
100,000.00 VONOVIA SE 0.2500 21-28 01/09A	76,312.89	0.15	100,000.00 AMERICAN TOWER 0.9500 21-30 05/10A	74,522.84	0.15
200,000.00 VONOVIA SE 0.375 21-27 16/06A	163,121.86	0.32	150,000.00 AMGEN INC 2.00 16-26 25/02A	144,297.51	0.28
100,000.00 VONOVIA SE 0.625 21-29 16/06A	72,765.96	0.14	100,000.00 BAXTER INTL 1.30 17-25 30/05A	94,919.51	0.19
100,000.00 VONOVIA SE 1.5 21-41 16/06A	54,594.00	0.11	100,000.00 BOSTON SCIENTIF CORP 0.6250 19-27 01/12A	86,036.01	0.17
Australie	96,914.06	0.19	200,000.00 CELANESE US 1.125 16-23 26/09A	193,709.48	0.38
100,000.00 TRANSURBAN FINANCE 1.875 14-24 16/09A	96,914.06	0.19	100,000.00 DANAHER CORP 2.5 20-30 30/03A	92,122.04	0.18
Autriche	266,904.51	0.52	350,000.00 DIGITAL EURO FINCO 1.125 19-28 09/10A	282,457.88	0.54
100,000.00 CA-IMMOBILIEN-ANLAGE 1 20-25 27/10A	87,191.05	0.17	200,000.00 DOW CHEMICAL CO 0.5 20-27 25/02A	169,174.22	0.33
100,000.00 ERSTE GROUP BANK AG FL.R 19-30 10/06A	86,363.83	0.17	100,000.00 EQUINIX INC 1 21-33 10/03A	70,729.22	0.14
100,000.00 TELEKOM FINANZMGT 1.50 16-26 07/12A	93,349.63	0.18	268,000.00 FEDEX CORP 1.625 16-27 11/01A	243,531.95	0.47
			100,000.00 FIDELITY NATIONAL INF 2.95 19-39 21/05A	77,919.37	0.15
			130,000.00 FIDELITY NATIONAL INF 1.5 19-27 21/05A	116,365.21	0.23
			100,000.00 GENERAL MILLS INC 0.1250 21-25 15/11A	90,271.47	0.18

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets		
	EUR			EUR			
100,000.00	KELLOGG CO 1.00 16-24 17/05A	96,951.50	0.19	100,000.00	KLEPIERRE 1.625 17-32 13/12A	70,648.03	0.14
100,000.00	KENNEDY WIL EUR REGS 3.25 15-25 12/11A	84,547.37	0.17	100,000.00	LA BANQUE POSTALE 1.375 19-29 24/04A	82,787.66	0.16
100,000.00	KRAFT HEINZ FOODS CO 2.25 16-28 25/05A	90,102.13	0.18	100,000.00	ORANGE 1.375 18-30 16/01A	86,941.15	0.17
200,000.00	MC DONALD S 1.875 15-27 26/05A	187,135.72	0.37	100,000.00	ORANGE SA 1.375 18-28 20/03A	90,087.29	0.18
100,000.00	MCDONALD'S CORP 0.8750 21-33 04/10A	72,326.18	0.14	100,000.00	ORANGE SA 2.0000 19-29 15/01A	92,263.73	0.18
200,000.00	MCDONALD'S CORP REGD 2.375 12-24 27/11A	198,448.00	0.39	100,000.00	ORANGE SA 1.25 20-27 07/04A	90,995.17	0.18
100,000.00	MCDONALD'S GROUP 2.625 14-29 11/06A	92,539.72	0.18	100,000.00	ORANGE SA 8.125 03-33 28/01A	132,370.55	0.26
100,000.00	MCKESSON CORP 1.50 17-25 17/11A	94,542.75	0.19	100,000.00	ORANGE SA 0.5 19-32 04/09A	73,513.21	0.14
100,000.00	MMS USA INVESTMENTS 1.7500 19-31 13/06A	79,718.68	0.16	100,000.00	ORANGE SA 1.00 18-25 12/09A	94,296.20	0.18
100,000.00	MONDELEZ INTERNATIONAL 0.25 21-28 17/03A	82,825.75	0.16	100,000.00	ORANGE SA 1.375 19-49 04/09A	65,527.89	0.13
100,000.00	MONDELEZ INTERNATIONAL 1.625 15-27 08/03	91,805.91	0.18	100,000.00	ORANGE SA 1.875 18-30 12/09A	88,508.22	0.17
100,000.00	MOODY'S CORP 0.95 19-30 25/02A	80,813.48	0.16	100,000.00	PUBLICIS GROUP 0.50 16-23 03/11A	97,430.15	0.19
100,000.00	NASDAQ INC 1.7500 19-29 28/03A	84,533.00	0.17	100,000.00	RCI BANQUE 0.5 22-25 14/07A	89,434.98	0.18
1,000.00	NATIONAL GRID 0.75 18-23 08/08A	980.54	0.00	66,000.00	RCI BANQUE SA 1.125 20-27 15/01A	56,354.08	0.11
200,000.00	NATIONAL GRID 1 17-24 12/07A	191,922.20	0.38	100,000.00	RCI BANQUE SA 0.50 16-23 15/09A	96,718.09	0.19
100,000.00	STRYKER CORP 0.75 19-29 01/03A	82,130.28	0.16	202,000.00	RCI BANQUE SA 1.375 17-24 08/03A	195,182.25	0.38
100,000.00	STRYKER CORP 2.125 18-27 30/11A	92,582.03	0.18	10,000.00	RENAULT SA 2 19-24 11/07A	9,671.33	0.02
227,000.00	VERIZON COMM 3.25 14-26 17/02A	226,580.30	0.43	200,000.00	SOCIETE GENERALE 0.875 19-29 24/09A	154,379.38	0.30
200,000.00	VERIZON COMMUNICATIO 1.3 20-33 18/05A	152,954.04	0.30	200,000.00	SOCIETE GENERALE 1.25 19-24 15/02A	194,014.16	0.38
100,000.00	VERIZON COMMUNICATION 0.875 19-27 08/04A	89,412.82	0.18	100,000.00	SOCIETE GENERALE 2.625 15-25 27/02A	95,702.09	0.19
100,000.00	VERIZON COMMUNICATION 0.875 19-32 19/03A	75,677.14	0.15	201,000.00	SODEXHO 2.50 14-26 24/06A	191,580.31	0.38
100,000.00	VERIZON COMMUNICATION 1.375 16-28 02/11A	88,330.35	0.17	300,000.00	SODEXO 1.125 18-25 22/05A	282,922.89	0.55
144,000.00	VERIZON COMMUNICATION 1.375 17-26 27/10A	133,660.10	0.26	100,000.00	SODEXO 1 20-29 27/04A	81,823.59	0.16
100,000.00	VERIZON COMMUNICATION 2.625 14-31 01/12A	90,636.67	0.18	100,000.00	SUEZ 1.50 17-29 03/04A	87,296.36	0.17
100,000.00	VERIZON COMMUNICATION 2.875 17-38 15/01A	84,356.66	0.17	100,000.00	SUEZ 1.625 18-30 17/09A	84,704.20	0.17
200,000.00	VF CORP 0.25 20-28 25/02A	163,311.44	0.32	100,000.00	SUEZ SA 1.25 20-35 14/05A	70,495.88	0.14
	Finlande	279,630.68	0.55	100,000.00	SUEZ 0.5 19-31 14/10A	73,211.57	0.14
100,000.00	BALDER FINLAND 2.0000 22-31 18/01A	68,042.79	0.13	100,000.00	TELEPERFORMANCE SE 1.875 18-25 02/07A	95,876.38	0.19
100,000.00	CASTELLUM HELSINKI 0.875 21-29 17/09A	64,355.40	0.13	100,000.00	UNIBAIL RODAMCO 2.25 18-38 15/05A	61,932.57	0.12
100,000.00	KOJAMO PLC 1.875 20-27 27/05A	84,354.49	0.17	100,000.00	UNIBAIL RODAMCO 1.75 19-34 27/02A	66,074.44	0.13
100,000.00	SBB TREASURY OY 0.7500 20-28 14/12A	62,878.00	0.12	100,000.00	UNIBAIL RODAMCO 2.50 14-26 04/06A	92,205.59	0.18
	France	7,340,674.78	14.39	100,000.00	UNIBAIL-RODAMCO 1.8750 18-31 15/01A	75,191.07	0.15
100,000.00	ARKEMA SA 0.75 19-29 03/12A	78,430.27	0.15	100,000.00	UNIBAIL-RODAMCO-WEST 0.625 20-27 04/12A	82,377.27	0.16
100,000.00	AUCHAN HOLDING SA 3.25 20-27 23/07A	89,610.07	0.18	200,000.00	UNIBAIL-RODAMCO-WEST 1.375 20-31 04/12A	140,289.66	0.27
300,000.00	BENI STABILI SPA 1.625 17-18 17/10A	292,367.91	0.57	100,000.00	UNIBAIL-RODAMCO-WEST 2.625 20-30 09/04A	82,138.08	0.16
100,000.00	BFCM 1.875 19-29 18/06A	80,347.77	0.16	300,000.00	VEOLIA ENVIRONN. 0.314 16-23 04/10A	293,047.68	0.58
96,000.00	BFCM 3.00 14-24 21/05A	94,915.73	0.19	200,000.00	VEOLIA ENVIRONNEMENT 0.892 19-24 14/01A	194,652.44	0.38
100,000.00	BNP PARIBAS 1.625 19-31 02/07A	72,662.81	0.14	100,000.00	VIVENDI 0.875 17-24 18/09A	95,670.51	0.19
197,000.00	BNP PARIBAS 2.875 16-26 01/10A	183,636.74	0.36	100,000.00	VIVENDI SA 0.6250 19-25 11/06A	93,140.06	0.18
100,000.00	CAPGEMINI SE 1.00 18-24 18/10A	96,185.75	0.19	200,000.00	WENDEL 2.50 15-27 09/02A	182,743.72	0.36
100,000.00	CAPGEMINI SE 2.0 20-29 15/04A	90,877.53	0.18		Ile de Jersey	153,257.06	0.30
100,000.00	CAPGEMINI SE 2.375 20-32 15/04A	86,858.54	0.17	100,000.00	APTIV PLC 1.60 16-28 15/09A	82,521.13	0.16
200,000.00	CARREFOUR SA 2.375 22-29 30/10A	175,139.68	0.34	100,000.00	HEATHROW FUNDING LTD 1.875 19-34 14/03A	70,735.93	0.14
100,000.00	CARREFOUR SA 2.625 20-27 01/04A	93,898.94	0.18		Irlande	1,069,608.61	2.10
200,000.00	CIE DE SAINT-GOBAIN 1.00 17-25 17/03A	189,834.62	0.37	142,000.00	CRH FINANCE 1.375 16-28 18/10A	122,995.26	0.24
200,000.00	COMPAGNIE DE SAINT-G 2.375 20-27 03/04A	188,874.12	0.37	200,000.00	DELL BANK INTERNATIO 1.625 20-24 24/06A	194,124.20	0.39
100,000.00	CREDIT MUTUEL ARKEA 3.375 19-31 11/03A	84,841.50	0.17	200,000.00	EATON CAPITAL UNLIMI 0.128 21-26 08/03A	178,349.34	0.35
200,000.00	DANONE SA 0 21-25 01/06A	181,524.76	0.36	100,000.00	EATON CAPITAL UNLTD 0.75 16-24 20/09A	95,504.91	0.19
200,000.00	DANONE SA 0.571 20-27 17/03A	178,080.54	0.35	100,000.00	FCA BANK S.P.A. - IR 0.5 20-23 18/09A	97,426.94	0.19
100,000.00	EDENRED SA 1.875 17-27 30/03A	93,981.39	0.18	100,000.00	FRESENIUS FIN IRL 2.125 17-27 01/02A	93,881.05	0.18
100,000.00	EUTELSAT S.A. 1.5 20-28 13/10A	80,895.54	0.16	20,000.00	FRESENIUS FIN IRL 3.00 17-32 30/01A	17,376.10	0.03
100,000.00	GROUPAMA ASSURANCES 0.75 21-28 07/07A	77,160.16	0.15	18,000.00	FRESENIUS FINANCE IR 0.5 21-28 01/04A	14,466.48	0.03
100,000.00	ICADE SA 1.75 16-26 10/06A	91,630.16	0.18	16,000.00	FRESENIUS FINANCE IR 0.875 21-31 01/04A	11,547.99	0.02
100,000.00	IMERYS SA 2.00 14-24 10/12A	95,910.07	0.19	100,000.00	GRENKE FINANCE 1.6250 19-24 05/04A	94,275.19	0.18
200,000.00	JC DECAUX SE 2.625 20-28 24/04A	171,159.08	0.34	100,000.00	KERRY GROUP FIN SERV 0.625 19-29 20/09A	79,168.98	0.16
100,000.00	KLEPIERRE 1.375 17-27 16/02A	87,651.22	0.17				

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets		
	EUR			EUR			
80,000.00	SMURFIT KAPPA 1.50 19-27 15/09S	70,492.17	0.14	100,000.00	DEUT TELEKOM INT FIN 1.50 16-28 03/04A	90,784.35	0.18
	Italie	2,789,024.29	5.46	170,000.00	DEUT TELEKOM INT FIN 7.50 03-33 24/01A	220,032.59	0.43
100,000.00	ACEA SPA 2.625 14-24 15/07A	98,810.19	0.19	100,000.00	DEUTSCHE TELEKOM AG 1.375 17-27 30/01A	92,681.69	0.18
100,000.00	ANIMA HOLDING S.P.A. 1.5 21-28 22/04A	80,139.41	0.16	100,000.00	DEUTSCHE TELEKOM 0.625 17-24 13/12A	95,351.00	0.19
100,000.00	ASSICURAZ GENERALI 2.124 19-30 01/10A	74,656.82	0.15	100,000.00	EDP FINANCE 1.875 17-23 29/09A	98,837.68	0.19
100,000.00	ASSICURAZ GENERALI 2.429 20-31 14/07A	74,139.88	0.15	300,000.00	EDP FINANCE 1.875 18-25 12/10A	287,580.87	0.57
100,000.00	ASSICURAZ GENERALI 5.125 09-24 16/09A	103,496.42	0.20	246,000.00	EDP FINANCE BV 1.625 18-26 26/01A	231,438.74	0.46
100,000.00	A2A SPA / EX AEM 1.0 21-33 02/11A	64,444.02	0.13	100,000.00	ESSITY CAPITAL BV 0.25 21-29 15/09A	77,364.31	0.15
100,000.00	A2A 1.75 15-25 25/02A	95,753.77	0.19	200,000.00	EURONEXT NV 1.1250 19-29 12/06A	165,657.02	0.32
100,000.00	INTESA SANPAOLO 0.75 19-24 04/12A	94,077.38	0.18	100,000.00	EXOR N.V. 0.875 21-31 19/01A	75,000.25	0.15
72,000.00	INTESA SANPAOLO 1.00 19-26 19/11A	62,591.98	0.12	100,000.00	EXOR REGS 2.875 15-25 22/12A	97,772.45	0.19
100,000.00	INTESA SANPAOLO 1.0000 19-24 04/07A	95,471.73	0.19	100,000.00	JDE PEETS B.V. 0.5 21-29 16/06A	76,353.88	0.15
100,000.00	INTESA SANPAOLO 1.75 19-29 04/07A	81,994.70	0.16	200,000.00	KONINKLIJKE 0.875 17-24 19/09A	192,083.86	0.38
100,000.00	INTESA SANPAOLO 2.1250 20-25 26/05A	95,208.80	0.19	100,000.00	KONINKLIJKE KPN NV 0.875 20-32 14/09A	73,096.98	0.14
135,000.00	INTESA SANPAOLO 4.00 13-23 30/11A	135,905.17	0.27	100,000.00	LEASEPLAN CORPO 0.2500 21-26 07/09A	84,979.98	0.17
126,000.00	IREN SPA 0.875 16-24 04/11A	118,856.58	0.23	130,000.00	LEASEPLAN CORPORATION 0.25 21-26 23/02A	113,281.73	0.22
100,000.00	ITALGAS SPA 1.0 19-31 11/12A	71,395.91	0.14	100,000.00	LEASEPLAN CORPORATION 1.375 19-24 07/03A	97,097.69	0.19
100,000.00	MEDIOBANCA DI C 0.7500 20-27 15/07A	83,706.01	0.16	100,000.00	MONDELEZ INTERNATION 0.20-26 22/09A	87,004.09	0.17
200,000.00	MEDIOBANCA-BCA CREDI 1.0 22-29 17/07A	159,274.26	0.31	101,000.00	MONDELEZ INTERNATION 0.375 20-29 22/09A	79,598.09	0.16
200,000.00	POSTE ITALIANE SPA 0.50 20-28 10/12A	156,334.96	0.31	100,000.00	MONDELEZ INTL HLDINGS 0.625 21-32 09/09A	73,111.58	0.14
500,000.00	SNAM S.P.A. 0.625 21-31 30/06A	355,806.35	0.69	100,000.00	NE PROPERTY BV 2.0 22-30 20/01A	70,292.08	0.14
200,000.00	TERNA SPA 1.375 17-27 26/07A	179,291.58	0.35	100,000.00	NE PROPERTY BV 1.75 17-24 23/11A	92,032.71	0.18
200,000.00	UGF 3.00 15-25 18/03A	193,868.92	0.38	181,000.00	NETHERLANDS 1.25 16-26 08/09A	144,318.99	0.28
250,000.00	UNICREDIT SPA FL.R 20-26 20/01A	227,890.05	0.44	100,000.00	NIBC BANK NV 0.875 19-25 08/07A	90,707.19	0.18
100,000.00	UNIPOL GRUPPO S.P.A. 3.25 20-30 23/09A	85,909.40	0.17	100,000.00	PROSUS NV 2.7780 22-34 19/01A	70,115.25	0.14
	Japon	354,380.53	0.69	100,000.00	PROSUS N.V. 1.288 21-29 13/07A	70,586.75	0.14
175,000.00	TAKEDA PHARMACEUTICAL 2.25 18-26 21/11A	167,465.87	0.33	100,000.00	PROSUS N.V. 1.539 20-28 03/08A	75,583.34	0.15
200,000.00	TAKEDA PHARMACEUTICAL 3.00 18-30 21/11A	186,914.66	0.36	200,000.00	RELX FINANCE BV 0.0 20-24 18/03A	191,038.04	0.37
	Lithuanie	112,518.32	0.22	93,000.00	REN FINANCE 2.50 15-25 12/02A	90,399.34	0.18
170,000.00	EWE AG 0.3750 20-32 22/10A	112,518.32	0.22	16,000.00	SUDZUCKER INT FINAN 1.25 16-23 29/11A	15,615.79	0.03
	Luxembourg	1,383,426.56	2.71	100,000.00	VONOVIA FINANCE BV 1.00 20-30 09/07A	73,466.39	0.14
300,000.00	AROUNDTOWN SA 0 20-26 16/12A	237,268.41	0.46	200,000.00	VONOVIA FINANCE BV 1.5 18-28 14/01A	169,714.28	0.33
100,000.00	BECTON DICKINSON EURO 1.336 21-41 13/08A	60,535.25	0.12	100,000.00	VONOVIA FINANCE BV 2.25 15-23 15/12A	98,444.69	0.19
100,000.00	CNH INDUSTRIAL 1.625 19-29 03/07A	84,616.71	0.17	100,000.00	WINTERSHALL DEA 1.8230 19-31 25/09A	75,125.32	0.15
100,000.00	DH EUROPE FIN 0.45 19-28 18/03A	84,652.89	0.17	200,000.00	WINTERSHALL DEA FINA 0.452 19-23 25/09A	193,743.06	0.38
350,000.00	DH EUROPE FIN 0.75 19-31 18/09A	270,078.66	0.52	100,000.00	WOLTERS KLUWER N.V. 0.25 21-28 30/03A	83,122.57	0.16
164,000.00	DH EUROPE FIN 1.35 19-39 18/09A	109,004.88	0.21	100,000.00	WPC EUROBOND BV 1.350 19-28 15/04A	82,358.55	0.16
29,000.00	HEIDELBERGCEMENT 1.5 17-27 14/06A	26,057.65	0.05	50,000.00	WPC EUROBOND BV 2.25 17-24 19/07A	48,226.90	0.09
100,000.00	HIGHLAND HOLDIN 0.9340 21-31 15/12A	74,098.19	0.15		Royaume-Uni	3,330,483.74	6.52
100,000.00	HOLCIM FINANCE 0.1250 21-27 19/07A	83,871.93	0.16	100,000.00	ANGLO AMERICAN CAP 1.625 17-25 18/09A	94,014.77	0.18
250,000.00	HOLCIM FINANCE 0.5000 20-31 23/04A	176,849.00	0.35	100,000.00	AVIVA PLC 3.375 15-45 04/12A	94,769.28	0.19
100,000.00	HOLCIM FINANCE 2.25 16-28 26/05A	90,682.25	0.18	86,000.00	BARCLAYS PLC 0.577 21-29 09/08A	65,873.44	0.13
100,000.00	WHIRLPOOL FINANCE 1.10 17-27 09/11A	85,710.74	0.17	129,000.00	BARCLAYS PLC 1.125 21-31 22/03A	106,410.97	0.21
	Pays-Bas	4,966,369.51	9.74	123,000.00	BARCLAYS PLC 1.875 16-23 08/12A	120,955.85	0.24
100,000.00	ADECCO INTERNATIONAL 1.25 19-29 20/11A	80,889.44	0.16	300,000.00	BRITISH TELECOM 2.125 18-28 26/09A	269,913.96	0.52
100,000.00	AKZO NOBEL NV 1.5 22-28 28/03A	88,237.35	0.17	100,000.00	BRITISH TELECOM 0.875 18-23 26/09A	97,870.71	0.19
100,000.00	COCA-COLA CO 1.000 16-24 11/11A	97,579.55	0.19	67,000.00	BRITISH TELECOM 1.50 17-27 23/06A	60,110.52	0.12
100,000.00	COCA-COLA HBC FIN 1.000 19-27 14/05A	89,439.64	0.18	118,000.00	COCA-COLA EUROPEAN 1.125 16-24 26/05A	114,496.93	0.22
99,000.00	CONTI-GUMMI FINANCE 1.125 20-24 25/06A	94,921.79	0.19	100,000.00	COCA-COLA EUROPEAN 1.75 16-28 26/05A	89,442.46	0.18
17,000.00	CONTI-GUMMI FINANCE 2.125 20-23 27/05A	16,771.35	0.03	100,000.00	DS SMITH PLC 0.8750 19-26 12/09A	85,206.34	0.17
100,000.00	CRH FUNDING B.V. 1.625 20-30 05/05A	83,078.74	0.16	100,000.00	EASYJET PLC 0.8750 19-25 11/06A	89,895.65	0.18
100,000.00	DAIMLER TRUCK INTL FI 1.625 22-27 06/04A	90,413.96	0.18	200,000.00	HSBC HOLDINGS PLC 3.00 15-25 30/06A	194,125.00	0.38
50,000.00	DEUT TELEKOM INT FIN 2.00 18-29 01/12A	45,429.41	0.09	200,000.00	INFORMA PLC 2.125 20-25 06/10A	185,469.70	0.36
139,000.00	DEUT TELEKOM INT FIN 0.875 17-24 30/01A	135,608.21	0.27	200,000.00	INTERCONT HOTELS GRP 2.125 18-27 15/11A	176,811.42	0.35
				100,000.00	MONDI FINANCE 1.50 16-24 15/04A	96,639.53	0.19
				100,000.00	MONDI FINANCE P 1.6250 18-26 27/04A	91,165.31	0.18

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
200,000.00 NATIONAL GRID PLC 0.553 20-29 18/09A	154,677.50	0.30			
100,000.00 PEARSON FUNDING 1.375 15-25 06/05A	94,270.68	0.18			
150,000.00 ROYAL MAIL PLC 1.2500 19-26 08/10A	133,882.22	0.26			
100,000.00 SSE 2.875 22-29 01/08A	92,001.46	0.18			
100,000.00 SSE PLC 1.375 18-27 04/09A	89,398.44	0.18			
100,000.00 STANDARD CHARTERED 1.2 21-31 23/03A	82,348.66	0.16			
100,000.00 VODAFONE GROUP PLC 1.875 14-25 11/09A	96,474.24	0.19			
100,000.00 VODAFONE GROUP 1.125 17-25 20/11A	94,001.87	0.18			
100,000.00 VODAFONE GROUP 1.50 17-27 24/07A	91,841.25	0.18			
200,000.00 VODAFONE GROUP 1.6250 19-30 24/11A	169,477.16	0.33			
200,000.00 WPP FINANCE SA 3.00 13-23 20/11A	198,938.42	0.39			
Suède	655,900.52	1.28			
100,000.00 AB SAGAX 2.25 19-25 13/03A	92,991.19	0.18			
100,000.00 FASTIGHETS AB BALDER 1.875 17-25 14/03A	88,080.99	0.17			
100,000.00 SAMHALLSBYGGNADSBOLA 1 20-27 12/02A	68,866.92	0.13			
100,000.00 SECURITAS 1.25 18-25 03/06A	93,295.00	0.18			
100,000.00 SKF AB 1.2500 18-25 17/09A	93,958.36	0.18			
100,000.00 SVENSKA KULLAGERFABRI 0.875 19-29 15/11A	81,042.57	0.16			
55,000.00 TELEFON AB L.M.ERICS 1 21-29 26/05A	39,662.97	0.08			
100,000.00 TELIA COMPANY AB 3.00 12-27 07/09A	98,002.52	0.20			
Suisse	59,980.21	0.12			
100,000.00 CREDIT SUISSE GROUP 0.625 21-33 18/01A	59,980.21	0.12			
Obligations à taux flottant	5,304,940.36	10.39			
Allemagne	346,659.97	0.68			
100,000.00 DEUTSCHE BANK AG 1.75 20-30 19/11A	75,819.11	0.15			
200,000.00 DEUTSCHE BANK AG 1.0 20-25 19/11A	184,410.38	0.36			
1,000.00 FRESENIUS SE CO. KG 0.375 20-26 28/09A	877.07	0.00			
100,000.00 MERCK KGAA FL.R 19-79 25/06A	85,553.41	0.17			
Australie	188,890.23	0.37			
201,000.00 COMMONW BK AUSTRALIA FL.R 17-29 03/10A	188,890.23	0.37			
Autriche	163,827.17	0.32			
100,000.00 ERSTE GROUP BANK AG FL.R 20-31 08/09	84,866.29	0.17			
100,000.00 RAIFFEISEN BANK INTE FL.R 20-32 18/06A	78,960.88	0.15			
Belgique	80,113.76	0.16			
100,000.00 KBC GROUP NV FL.R 21-31 07/12A	80,113.76	0.16			
Danemark	355,257.05	0.70			
100,000.00 DANSKE BANK A/S FL.R 19-25 27/08A	93,267.89	0.18			
100,000.00 JYSKE BANK A/S FL.R 20-25 15/10A	92,926.66	0.18			
200,000.00 ORSTED FL.R 19-XX 09/12A	169,062.50	0.34			
Espagne	276,502.40	0.54			
100,000.00 BANCO BILBAO VI -29 14/01A	81,752.92	0.16			
200,000.00 CAIXABANK SA FL.R 19-29 15/02A	194,749.48	0.38			
Finlande	73,306.10	0.14			
100,000.00 SAMPO PLC FL.R 20-52 03/09A	73,306.10	0.14			
France	836,253.62	1.64			
200,000.00 CREDIT AGRICOLE FL.R 20-30 05/06A	181,006.42	0.35			
200,000.00 CREDIT AGRICOLE FL.R 16-48 27/09A	185,676.28	0.37			
200,000.00 GROUPE DES FL.R 21-42 21/04A	142,345.44	0.28			
200,000.00 SOCIETE GENERALE FL.R 21-29 12/01A	157,177.10	0.31			
200,000.00 SOCIETE GENERALE FL.R 20-30 24/11A	170,048.38	0.33			
			Irlande	88,057.11	0.17
			100,000.00 AIB GROUP FL.R 22-28 04/04A	88,057.11	0.17
			Italie	373,110.32	0.73
			100,000.00 ASSICURAZ GENERALI FL.R 15-47 27/10A	95,984.50	0.19
			200,000.00 UNICREDIT SPA FL.R 20-26 16/06A	182,256.68	0.35
			100,000.00 UNICREDIT SPA FL.R 19-25 25/06A	94,869.14	0.19
			Norvège	87,331.53	0.17
			100,000.00 SPAREBANK 1 SR-BANK FL.R 21-27 15/07A	87,331.53	0.17
			Pays-Bas	824,044.94	1.61
			100,000.00 AEGON NV FL.R 14-44 25/04A	96,056.30	0.19
			100,000.00 ASR NEDERLAND NV FL.R 19-49 02/05A	83,675.13	0.16
			100,000.00 ATHORA NETHERLANDS FL.R 22-32 31/08A	90,940.10	0.18
			300,000.00 ING GROUP NV FL.R 17-29 26/09A	278,213.49	0.54
			200,000.00 ING GROUP NV FL.R 20-31 26/05A	178,102.92	0.35
			100,000.00 NN GROUP NV FL.R 14-44 08/04A	97,057.00	0.19
			Pologne	76,510.64	0.15
			100,000.00 MBANK SA FL.R 21-27 21/09A	76,510.64	0.15
			Royaume-Uni	929,076.45	1.82
			100,000.00 BARCLAYS PLC FL.R 22-27 31/01A	93,417.79	0.18
			200,000.00 BARCLAYS PLC 1.106 21-32 12/05A	140,816.06	0.28
			138,000.00 BARCLAYS PLC FL.R 20-25 02/04A	136,206.50	0.27
			14,000.00 LLOYDS BANKING GROUP FL.R 18-28 07/09A	13,412.56	0.03
			100,000.00 NATWEST GROUP PLC FL.R 18-26 02/03A	93,570.74	0.18
			200,000.00 NATWEST GROUP PLC FL.R 19-25 15/11A	186,449.06	0.37
			201,000.00 SANTANDER UK GROUP FL.R 20-25 28/02A	190,786.23	0.36
			100,000.00 SWISS RE FINANCE (UK) FL.R 20-52 04/06A	74,417.51	0.15
			Suède	173,984.62	0.34
			202,000.00 TELIA COMPANY AB FL.R 20-81 11/02A	173,984.62	0.34
			Suisse	432,014.45	0.85
			90,000.00 CREDIT SUISSE FL.R 17-25 17/07A	83,617.95	0.16
			100,000.00 CREDIT SUISSE FL.R 20-26 02/04A	94,839.90	0.19
			100,000.00 CREDIT SUISSE FL.R 20-28 14/01A	79,947.39	0.16
			100,000.00 CREDIT SUISSE GROUP FL.R 22-26 13/10A	90,056.05	0.18
			100,000.00 CREDIT SUISSE GROUP FL.R 19-27 24/06A	83,553.16	0.16
			Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	6,309,135.57	12.36
			Obligations	5,272,515.85	10.33
			Allemagne	232,565.55	0.46
			300,000.00 LEG IMMOBILIEN 0.8750 22-29 17/01A	232,565.55	0.46
			Australie	638,511.95	1.25
			301,000.00 APA INFRASTRUCTURE 2.00 15-27 22/03A	271,891.26	0.53
			200,000.00 AUS PAC AIRPORT REGS 1.75 14-24 15/10	192,058.54	0.38
			100,000.00 AUSNET SERVICES HOLDI 1.50 15-27 26/02A	90,364.66	0.18
			100,000.00 AUSTRALIA NEW ZEALA 0.669 21-31 05/02A	84,197.49	0.16
			Espagne	332,409.26	0.65
			100,000.00 ABERTIS INFRASTRUCT 2.250 20-29 29/03A	86,493.59	0.17
			100,000.00 ACCIONA ENERGIA FINA1.375 22-32 26/01A	76,580.56	0.15
			100,000.00 FERROVIAL EMISIONES 0.54 20-28 12/11A	80,096.91	0.16
			100,000.00 TELEFONICA EMISIONES 1.201 20-27 21/05A	89,238.20	0.17

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Etats-Unis d'Amérique	148,396.02	0.29	Obligations à taux flottant	1,036,619.72	2.03
100,000.00 AMERICAN TOWER CORP 0.875 21-29 21/05A	78,234.42	0.15	Danemark	89,391.15	0.18
100,000.00 VERIZON COMMUNICATIO 1.85 20-40 18/05A	70,161.60	0.14	100,000.00 DANSKE BANK A/S FL.R 22-27 17/02A	89,391.15	0.18
Finlande	142,404.86	0.28	Espagne	88,788.20	0.17
200,000.00 UPM-KYMMENE CORP 0.5 21-31 22/03A	142,404.86	0.28	100,000.00 BANCO DE SABADELL SA FL.R 20-27 11/09A	88,788.20	0.17
France	730,308.12	1.43	France	516,830.50	1.01
200,000.00 ALSTOM SA 0 21-29 11/01A	153,917.68	0.30	200,000.00 BFCM BANQUE FEDERAT FL.R 22-32 16/06A	182,027.26	0.35
200,000.00 BPCE SA 1.75 22-34 02/02A	156,810.28	0.31	200,000.00 BNP PARIBAS FL.R 22-32 31/03A	171,818.92	0.34
100,000.00 BPCE 2.25 22-32 03/23A	86,677.45	0.17	100,000.00 LA BANQUE POSTALE FL.R 21-32 02/02A	77,896.04	0.15
200,000.00 HOLDING D'INFRASTRUC 2.5 20-27 04/05A	185,120.42	0.36	100,000.00 SOCIETE GENERALE SA FL.R 21-27 02/12A	85,088.28	0.17
100,000.00 ICADE SA 1.00 22-30 19/01A	76,257.14	0.15	Irlande	97,141.52	0.19
100,000.00 ORANGE SA 0.6250 21-33 16/12A	71,525.15	0.14	100,000.00 AIB GROUP FL.R 22-26 04/07A	97,141.52	0.19
Ile de Jersey	76,846.95	0.15	Italie	166,890.72	0.33
100,000.00 HEATHROW FUNDING LIM 1.125 21-30 08/04A	76,846.95	0.15	200,000.00 UNICREDIT FL.R 22-28 18/01A	166,890.72	0.33
Irlande	599,994.16	1.18	Suisse	77,577.63	0.15
155,000.00 CCEP FINANCE (IRELAN 0 21-25 06/05A	140,868.46	0.28	100,000.00 CRED SUIS SA AG FL.R 22-32 02/04A	77,577.63	0.15
163,000.00 CCEP FINANCE (IRELAN 0.875 21-33 06/05A	117,107.12	0.23	Autres valeurs mobilières	2,174,237.76	4.26
100,000.00 DXC CAPITAL FUNDING 0.95 21-31 15/09A	73,360.36	0.14	Obligations	1,629,876.68	3.19
200,000.00 FCA BANK SPA IE 0.125 20-23 16/11A	192,875.30	0.38	Allemagne	91,795.87	0.18
100,000.00 JOHNSON CONTROLS INT 1 20-32 15/09A	75,782.92	0.15	100,000.00 FRESENIUS SE AND CO 2.875 19-29 15/02A	91,795.87	0.18
Italie	723,592.31	1.42	Australie	78,731.46	0.15
200,000.00 ACEA SPA 0.25 21-30 28/07A	145,020.04	0.28	100,000.00 WOOLWORTHS GROU 0.3750 21-28 15/11A	78,731.46	0.15
100,000.00 ASTM SPA 1.5000 21-30 25/01A	76,152.80	0.15	Espagne	67,733.94	0.13
100,000.00 ASTM SPA 2.3750 21-33 25/11A	70,846.65	0.14	100,000.00 TELEFONICA EMISIONES 1.864 20-40 13/07A	67,733.94	0.13
250,000.00 INTESA SANPAOLO 0.6250 21-26 24/02A	216,857.12	0.42	Etats-Unis d'Amérique	88,559.01	0.17
100,000.00 ITALGAS S.P.A. 0 21-28 16/02A	79,319.52	0.16	108,000.00 CELANESE US HOL 2.1250 18-27 01/03A	88,559.01	0.17
100,000.00 ITALGAS S.P.A. 0.5 21-33 16/02A	64,104.52	0.13	Finlande	186,786.38	0.37
100,000.00 UNICREDIT SPA 1.625 22-32 18/01A	71,291.66	0.14	200,000.00 KOJAMO 1.50 17-24 19/06A	186,786.38	0.37
Luxembourg	346,992.13	0.68	France	338,221.88	0.66
150,000.00 EUROFINS SCIENT 0.8750 21-31 19/05A	107,603.07	0.21	200,000.00 ALD SA 1.25 22-26 02/03A	179,864.02	0.35
200,000.00 GRAND CITY PROPRTIE 0.125 21-28 11/01A	148,834.70	0.29	100,000.00 IMERYS 1.875 16-28 31/03A	85,076.78	0.17
100,000.00 SES 3.5 22-29 14/01A	90,554.36	0.18	100,000.00 UNIBAIL-RODAMCO-WEST 2 20-32 29/06A	73,281.08	0.14
Pays-Bas	920,455.65	1.80	Italie	133,903.47	0.26
100,000.00 AKZO NOBEL NV 2.0 22-32 28/03A	81,384.65	0.16	100,000.00 HERA S.P.A 1 21-34 25/04A	64,844.15	0.13
100,000.00 AMERICAN MEDICAL SYS 0.75	94,209.61	0.18	100,000.00 HERA S.P.A. 0.25 20-30 03/12A	69,059.32	0.13
100,000.00 DE VOLKSBANK NV F.LR 22-27 04/05A	93,066.59	0.18	Pays-Bas	294,981.92	0.58
100,000.00 KONINKLIJKE KPN 0.8750 21-33 15/11A	70,614.46	0.14	100,000.00 ABN AMRO BANK 1.25 22-34 20/01A	70,594.63	0.14
100,000.00 RENTOKIL INITIAL FIN 3.875 22-27 27/06A	98,402.36	0.19	200,000.00 ABN AMRO BANK NV 1 21-33 02/06A	142,645.94	0.28
100,000.00 SIGNIFY N.V. 2 20-24 11/05A	97,281.90	0.19	100,000.00 VONOVIA FINANCE BV 0.625 19-27 07/10A	81,741.35	0.16
400,000.00 UNIVERSAL MUSIC GROUP N 3.0 22-27 30/06A	385,496.08	0.76	Royaume-Uni	264,780.01	0.52
Royaume-Uni	308,058.79	0.60	100,000.00 BARCLAYS 1.5 18-23 03/09A	98,602.30	0.20
100,000.00 CADENT FINANCE PLC 0.625 21-30 19/03A	74,746.75	0.15	100,000.00 INTERMEDIATE CAPITAL GR 2.5 22-30 28/01A	73,226.00	0.14
100,000.00 COLOPLAST FINANCE 2.25 22-27 19/05A	93,963.84	0.18	100,000.00 SSE PLC 0.875 17-25 06/09A	92,951.71	0.18
106,000.00 NATIONAL GRID ELECTR 0.872 20-40 26/11A	56,616.84	0.11	Suède	84,382.74	0.17
100,000.00 THAMES WATER UTILITIE 0.875 22-28 31/01A	82,731.36	0.16	100,000.00 ALFA LAVAL TREASURY I 1.375 22-29 18/02A	84,382.74	0.17
Suède	71,980.10	0.14			
100,000.00 SAGAX EURO MTN NL B. 0.75 21-28 26/01A	71,980.10	0.14			

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité		Valeur d'évaluation	% actifs nets
		EUR	
Obligations à taux flottant		544,361.08	1.07
	Danemark	95,273.14	0.19
100,000.00	DANSKE BANK FL.R 19-29 21/06A	95,273.14	0.19
	Irlande	92,454.97	0.18
100,000.00	BANK OF IRELAND GROUP FL.R 22-26 05/06A	92,454.97	0.18
	Royaume-Uni	356,632.97	0.70
100,000.00	NATWEST GROUP PLC FL.R 21-30 26/02A	76,191.05	0.15
300,000.00	SANTANDER UK GROUP FL.R 22-28 25/08A	280,441.92	0.55
Total portefeuille-titres		49,468,698.59	96.92

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	USD			USD	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	1,432,238,757.25	94.85	4,900,000.00 ROYAL BANK OF CANADA FL.R 21-24 07/10Q	4,812,280.93	0.32
Obligations	4,605,456.37	0.31	1,200,000.00 ROYAL BANK OF CANADA FL.R 21-26 02/11Q	1,157,532.48	0.08
Etats-Unis d'Amérique	4,605,456.37	0.31	3,200,000.00 ROYAL BANK OF CANADA FL.R 22-25 21/01Q	3,138,944.48	0.21
4,630,000.00 STARBUCKS SOFFRAT FL.R 22-24 14/02Q	4,605,456.37	0.31	1,200,000.00 ROYAL BANK OF CANADA FL.R 21-24 29/07Q	1,184,922.78	0.08
Obligations à taux flottant	1,427,633,300.88	94.54	450,000.00 ROYAL BANK OF CANADA FL.R 21-26 20/01Q	436,469.96	0.03
Australie	104,189,361.69	6.90	8,020,000.00 ROYAL BANK OF CANADA FL.R 20-23 26/10Q	7,979,587.62	0.53
8,920,000.00 COMMONWEALTH BA FL.R 19-24 04/06Q	8,929,123.38	0.59	6,309,000.00 ROYAL BANK OF CANADA FL.R 21-24 19/01Q	6,261,828.87	0.41
6,720,000.00 CW BK AUST AUTRE FL.R 22-25 14/03Q	6,693,478.85	0.44	2,595,000.00 ROYAL BANK OF CANADA 3.068 18-23 05/10Q	2,598,488.98	0.17
3,100,000.00 CWTH BL AUS. FL.R 18-23 16/03Q	3,101,501.17	0.21	7,330,000.00 ROYAL BANK OF CANADA FL.R 20-23 17/01Q	7,322,556.38	0.48
4,427,000.00 MACQUARIE FL.R 18-24 27/03Q	4,429,571.20	0.29	3,800,000.00 ROYAL BANK OF CANADA FL.R 22-25 14/04Q	3,750,265.60	0.25
4,700,000.00 MACQUARIE GROUP LTD FL.R 21-27 23/06Q	4,506,430.50	0.30	1,500,000.00 TORONTO DOMINION BANK FL.R 21-26 10/09Q	1,448,852.55	0.10
5,760,000.00 MACQUARIE GRP REGS FL.R 17-23 28/11Q	5,751,308.16	0.38	2,500,000.00 TORONTO DOMINION BANK FL.R 22-24 08/03Q	2,493,606.62	0.17
3,983,000.00 MACQUARIE SOFFRAT F.LR 22-25 21/03Q	4,010,960.66	0.27	6,786,000.00 TORONTO DOMINION BANK FL.R 20-23 27/01Q	6,783,790.14	0.45
2,750,000.00 NATIONAL AUSTRALIA FL.R 22-25 09/06Q	2,737,299.67	0.18	3,980,000.00 TORONTO DOMINION BANK FL.R 21-23 02/06Q	3,963,920.80	0.26
6,350,000.00 NATIONAL AUSTRALIA FL.R 22-27 12/01Q	6,206,059.16	0.41	6,337,000.00 TORONTO DOMINION BANK FL.R 21-24 04/03Q	6,283,103.81	0.42
7,125,000.00 NATIONAL AUSTRALIA B FL.R 20-22 13/01Q	7,113,710.44	0.47	9,150,000.00 TORONTO DOMINION BANK FL.R 21-24 10/09Q	9,033,859.51	0.60
4,400,000.00 NATIONAL AUSTRALIA BAN FL.R 18-23 12/04Q	4,400,559.68	0.29	2,733,000.00 TORONTO DOMINION BANK FL.R 19-22 01/12Q	2,730,230.51	0.18
7,250,000.00 NATL AUSTRALIA BANK FL.R 22-25 12/01Q	7,158,655.80	0.47	3,000,000.00 TORONTO DOMINION BANK FL.R 22-25 06/06Q	2,974,769.85	0.20
4,649,000.00 UBS GR FUNDING FL.R 17-23 11/01Q	4,649,454.21	0.31	3,140,000.00 TORONTO-DOMINIO FL.R 20-23 28/09Q	3,128,748.43	0.21
3,000,000.00 WESTPAC BANKING FL.R 22-25 26/08Q	2,998,611.00	0.20	2,445,000.00 TORONTO-DOMINION BANK FL.R 18-23 19/07Q	2,443,875.30	0.16
7,249,000.00 WESTPAC BANKING CORP FL.R 18-23 15/05Q	7,254,100.04	0.48	Danemark	2,998,611.90	0.20
7,106,000.00 WESTPAC BANKING CORP FL.R 19-24 26/02Q	7,127,989.51	0.47	3,000,000.00 DANSKE BANK A/S FL.R 18-23 12/09Q	2,998,611.90	0.20
7,093,000.00 WESTPAC BANKING CORP FL.R 20-23 16/01Q	7,088,477.86	0.47	Espagne	15,394,889.30	1.02
3,800,000.00 WESTPAC BANKING CORP FL.R 21-24 18/11Q	3,755,616.00	0.25	6,000,000.00 BANCO NTANDER SOFFRA FL.R 22-24 24/05Q	5,992,905.90	0.40
6,400,000.00 WESTPAC BANKING CORP FL.R 21-26 03/06Q	6,276,454.40	0.42	3,400,000.00 BANCO SANTANDER FL.R 17-23 23/02Q	3,397,448.30	0.22
Canada	220,824,392.14	14.62	6,000,000.00 BANCO SANTANDER SA FL.R 18-23 12/04Q	6,004,535.10	0.40
200,000.00 BANK OF MONTREAL FL.R 21-23 14/04Q	199,471.50	0.01	Etats-Unis d'Amérique	750,651,448.49	49.70
3,850,000.00 BANK OF MONTREAL FL.R 22-25 10/01Q	3,786,227.45	0.25	7,532,000.00 ABBVIE INC FL.R 20-22 21/08Q	7,531,032.13	0.50
4,097,000.00 BANK OF MONTREAL FL.R 21-24 09/07Q	4,041,477.45	0.27	100,000.00 AIG GLOBAL FUNDING FL.R 20-23 15/12Q	99,545.50	0.01
4,654,000.00 BANK OF MONTREAL FL.R 21-26 15/09Q	4,513,313.07	0.30	5,500,000.00 AIR LEASE CORP FL.R 21-22 15/12Q	5,499,142.00	0.36
4,200,000.00 BANK OF MONTREAL FL.R 22-24 08/03Q	4,185,111.00	0.28	5,062,000.00 AMERICAN EXPRESS FL.R 18-23 03/08Q	5,066,963.29	0.34
5,166,000.00 BANK OF MONTREAL FL.R 20-23 08/12Q	5,137,044.57	0.34	5,000,000.00 AMERICAN EXPRESS CO FL.R 21-26 04/11Q	4,892,810.00	0.32
5,000,000.00 BANK OF MONTREAL AU FL.R 22-25 07/06Q	4,960,815.00	0.33	1,800,000.00 AMERICAN EXPRESS CO FL.R 18-23 27/02Q	1,798,309.08	0.12
5,175,000.00 BANK OF MONTREAL FL.R 21-23 15/09S	5,137,196.62	0.34	5,900,000.00 AMERICAN EXPRESS CO FL.R 21-23 03/11Q	5,859,906.55	0.39
5,000,000.00 BANK OF NOVA SC FL.R 22-25 11/04Q	4,944,321.00	0.33	3,047,000.00 AMERICAN HONDA FINAN FL.R 20-23 10/01Q	3,045,926.54	0.20
6,000,000.00 BANK OF NOVA SC FL.R 21-23 15/09Q	5,963,860.80	0.39	3,250,000.00 AMERICAN HONDA FINAN FL.R 20-23 10/09Q	3,243,863.35	0.21
5,800,000.00 BANK OF NOVA SCOTIA FL.R 21-24 31/07Q	5,735,506.61	0.38	2,702,000.00 AMERICAN HONDA FINANCE FL.R 17-22 16/11Q	2,699,569.68	0.18
3,000,000.00 BANK OF NOVA SCOTIA FL.R 22-24 11/03Q	2,997,426.00	0.20	5,950,000.00 AMERICAN HONDA FINANCE FL.R 21-23 22/02Q	5,937,208.10	0.39
14,428,000.00 BANK OF NOVA SCOTIA FL.R 20-23 16/09Q	14,380,353.69	0.95	1,100,000.00 AMERICAN HONDA FINANCE FL.R 21-24 12/01Q	1,095,689.32	0.07
5,865,000.00 BANK OF NOVA SCOTIA FL.R 21-24 19/04Q	5,812,337.28	0.38	5,400,000.00 AMEX AUTRE FL.R 22-25 04/03Q	5,391,592.20	0.36
3,300,000.00 BANK OF NOVA SCOTIA TO FL.R 22-25 10/01Q	3,239,649.43	0.21	6,000,000.00 AMEX SOFRIND FL.R 22-24 03/05Q	5,976,534.00	0.40
2,800,000.00 BANQUE NATIONALE DU CA FL.R 21-24 06/08Q	2,760,676.38	0.18	4,750,000.00 ANALOG DEVICES INC FL.R 21-24 01/10Q	4,695,142.49	0.31
2,738,000.00 BK OF NOVA SCOTIA FL.R 21-26 02/03Q	2,650,060.78	0.18	11,300,000.00 ATMOS ENERGY CORP FL.R 21-23 09/03Q	11,290,802.36	0.75
6,000,000.00 CAN IMP BK FL.R 22-25 07/04Q	5,929,950.00	0.39	6,000,000.00 AT&T INC FL.R 21-24 25/03Q	5,963,220.00	0.39
12,337,000.00 CANADIAN IMPERIAL FL.R 19-23 17/03Q	12,335,766.30	0.82	15,000,000.00 AT&T INC FL.R 18-24 12/06Q	15,046,050.00	0.99
4,934,000.00 CANADIAN IMPERIAL BANK FL.R 18-23 13/09Q	4,938,456.89	0.33	300,000.00 BANK OF AMERICA FL.R 22-26 02/04Q	298,105.50	0.02
8,915,000.00 CANADIAN IMPERIAL BANK FL.R 21-24 18/10Q	8,774,452.35	0.58	5,400,000.00 BANK OF AMERICA FL.R 22-28 04/02U	5,197,015.35	0.34
7,039,000.00 CIBC FL.R 20 23 14/12Q	6,994,502.96	0.46	2,400,000.00 BANK OF AMERICA CORP FL.R 18-24 23/07Q	2,400,828.00	0.16
5,700,000.00 ENBRIDGE INC FL.R 22-24 16/02Q	5,641,006.71	0.37	400,000.00 BANK OF AMERICA CORP FL.R 20-24 24/10Q	398,012.06	0.03
4,000,000.00 ENBRIDGE INC FL.R 21-23 19/02Q	3,993,050.00	0.26	4,200,000.00 BANK OF AMERICA CORP FL.R 22-25 04/02Q	4,165,488.81	0.28
5,100,000.00 FEDERATION DES CAISSES FL.R 21-24 21/05Q	5,016,792.99	0.33	14,718,000.00 BANK OF AMERICA CORP FL.R 18-26 05/02Q	14,520,439.55	0.95
1,571,000.00 ROYAL BANK OF C FL.R 21-26 27/04Q	1,513,512.08	0.10	11,060,000.00 BANK OF AMERICA CORP FL.R 18-24 05/03Q	11,032,405.30	0.73
5,500,000.00 ROYAL BANK OF C FL.R 22-27 21/01Q	5,314,417.63	0.35	1,090,000.00 BANK OF AMERICA CORP FL.R 21-27 22/07Q	1,053,238.22	0.07
			1,700,000.00 BANK OF AMERICA CORP FL.R 21-25 22/04Q	1,683,717.40	0.11
			2,500,000.00 BANK OF AMERICA SUB FL.R 06-26 15/09Q	2,427,011.50	0.16

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité		Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité		Valeur d'évaluation	% actifs nets
	USD				USD		
800,000.00	BANK OF NE FL.R 21-24 25/10Q	790,712.32	0.05	9,700,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP FL.R 18-23 23/02Q	9,696,336.79	0.64
4,000,000.00	BANK OF NEW YORK MEL F.LR 22-25 25/04Q	3,971,529.00	0.26	1,000,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP FL.R 21-24 10/09Q	986,707.15	0.07
6,500,000.00	BANK OF NY MELL FL.R 21-24 26/04Q	6,453,768.75	0.43	1,000,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP IN FL.R 20-23 17/11Q	995,476.70	0.07
6,988,000.00	BANK OF NY MELLON FL.R 16-23 30/10Q	6,984,471.06	0.46	1,500,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP IN FL.R 21-27 09/03Q	1,437,900.00	0.10
3,200,000.00	BAXTER INTERNATIONAL FL.R 22-24 29/11Q	3,122,496.00	0.21	4,200,000.00	GOLDMAN SACHS GRP FL.R 16-27 28/10Q	4,175,217.69	0.28
3,200,000.00	BAXTER INTERNATIONAL FL.R 22-23 01/12Q	3,167,024.00	0.21	3,500,000.00	HUNTINGTON NATL BANK FL.R 22-25 16/05Q	3,476,235.00	0.23
2,850,000.00	BK AMERICA SOFFRAT F.LR 22-25 25/04Q	2,837,118.57	0.19	2,500,000.00	HYATT HOTELS CO FL.R 21-22 01/10Q	2,500,000.00	0.17
6,800,000.00	BMW US CAPITAL LLC FL.R 21-24 12/08Q	6,745,107.00	0.45	2,382,000.00	JOHN DEERE FL.R 18-23 07/06Q	2,385,847.65	0.16
6,935,000.00	BMW US CAPITAL LLC FL.R 21-24 01/04Q	6,906,878.57	0.46	9,900,000.00	JOHN DEERE CAPITAL COR FL.R 21-23 10/07Q	9,875,270.79	0.65
6,000,000.00	BMW US LLC FL.R 22-25 01/04Q	6,005,889.90	0.40	5,550,000.00	JOHN DEERE CAPITAL COR FL.R 21-24 11/10Q	5,492,323.01	0.36
400,000.00	BRANCH BANKING FL.R 20-23 09/03Q	399,650.00	0.03	1,958,000.00	JOHN DEERE CAPITAL COR FL.R 22-25 07/03Q	1,943,965.16	0.13
8,795,000.00	CATERPILLAR FIN FL.R 21-24 13/09Q	8,712,221.02	0.58	3,000,000.00	JPM CHASE AUTRE FL.R 22-25 14/06Q	2,982,347.40	0.20
6,100,000.00	CATERPILLAR FINANCIA FL.R 21-22 17/05Q	6,096,882.29	0.40	4,000,000.00	JPM CHASE AUTRE FL.R 22-26 24/02Q	3,926,129.80	0.26
4,200,000.00	CATERPILLAR FINANCIAL FL.R 22-23 13/11Q	4,197,830.07	0.28	1,761,000.00	JPMORGAN FL.R 18-24 23/04Q	1,756,166.06	0.12
3,300,000.00	CATERPILLAR FINANCIAL FL.R 22-24 10/01Q	3,282,995.60	0.22	4,656,000.00	JPMORGAN FL.R 18-24 23/07Q	4,649,543.76	0.31
6,465,000.00	CATERPILLAR FINANCIALS FL.R 21-24 17/05Q	6,432,076.66	0.43	2,000,000.00	JPMORGAN CHASE FL.R 21-25 01/06Q	1,958,070.50	0.13
5,972,000.00	CENTERPOINT ENE FL.R 21-23 02/03Q	5,966,095.78	0.40	3,500,000.00	JPMORGAN CHASE FL.R 22-26 26/04Q	3,489,371.73	0.23
7,883,000.00	CENTERPOINT ENERGY FL.R 21-24 13/05Q	7,790,043.67	0.52	5,500,000.00	JPMORGAN CHASE FL.R 22-28 24/02Q	5,329,318.78	0.35
7,111,000.00	CHARLES SCHWAB FL.R 21-26 13/05Q	6,914,487.52	0.46	8,455,000.00	JPMORGAN CHASE & C FL.R 16-23 24/10Q	8,455,338.20	0.56
2,000,000.00	CHARLES SCHWAB CORP FL.R 22-27 03/03Q	1,969,387.70	0.13	2,118,000.00	JPMORGAN CHASE & CO FL.R 17-25 29/11Q	2,110,226.20	0.14
12,475,000.00	CHARLES SCHWAB CORP FL.R 21-24 18/03Q	12,408,246.28	0.82	3,000,000.00	JPMORGAN CHASE & CO FL.R 21-25 10/12Q	2,945,448.60	0.20
7,759,000.00	CIGNA CORPORATION FL.R 19-23 15/07Q	7,773,605.16	0.51	200,000.00	JPMORGAN CHASE & CO FL.R 21-25 23/06Q	195,835.25	0.01
2,739,000.00	CITIGROUP FL.R 18-26 12/06Q	2,728,433.48	0.18	2,800,000.00	JPMORGAN CHASE & CO FL.R 21-27 22/09Q	2,681,302.82	0.18
6,730,000.00	CITIGROUP FL.R 18-27 01/06Q	6,724,756.66	0.45	3,600,000.00	KEY BANK NA FL.R 20-24 03/01Q	3,575,372.40	0.24
5,000,000.00	CITIGROUP FL.R 22-28 24/02Q	4,808,735.00	0.32	3,500,000.00	KEYBANK NATIONAL ASSOC FL.R 21-24 14/06Q	3,462,978.92	0.23
3,150,000.00	CITIGROUP INC FL.R 21-27 09/06Q	3,052,045.55	0.20	4,900,000.00	MAGALLANES AUTRE FL.R 22-24 15/03Q	4,891,310.34	0.32
2,850,000.00	CITIGROUP INC FL.R 22-26 25/01Q	2,779,847.25	0.18	6,000,000.00	MET LIFE GLOB F FL.R 21-24 27/09Q	5,942,190.00	0.39
4,820,000.00	CITIGROUP INC FL.R 22-26 17/03Q	4,829,005.45	0.32	9,000,000.00	MET LIFE GLOB FUND FL.R 20-23 13/01Q	9,005,017.50	0.60
10,703,000.00	CITIGROUP INC FL.R 17-24 17/05Q	10,712,151.06	0.71	3,450,000.00	METROPOLITAN LIFE FL.R 22-25 21/03Q	3,392,519.38	0.22
3,930,000.00	CITIGROUP INC FL.R 21-25 01/05Q	3,881,582.80	0.26	7,000,000.00	METROPOLITAN LIFE GL FL.R 21-24 07/01Q	6,949,915.00	0.46
1,400,000.00	COMCAST CORP FL.R 18-24 15/04Q	1,401,283.24	0.09	5,100,000.00	MORGAN STANLEY FL.R 22-26 18/02Q	5,006,551.94	0.33
7,939,000.00	COOPERAT RABOBA FL.R 21-24 12/01Q	7,891,961.43	0.52	21,037,000.00	MORGAN STANLEY FL.R 16-23 24/10Q	21,038,184.39	1.38
6,420,000.00	COOPERAT RABOBA FL.R 22-25 10/01Q	6,337,236.57	0.42	12,427,000.00	MORGAN STANLEY FL.R 17-24 08/05Q	12,437,917.74	0.82
5,000,000.00	CREDIT SUISSE N FL.R 22-25 21/02Q	4,878,425.00	0.32	7,310,000.00	MORGAN STANLEY CAPITA FL.R 22-25 24/01 Q	7,175,184.60	0.48
9,027,000.00	CREDIT SUISSE NEW YO 21-24 02/02Q	8,862,087.10	0.59	750,000.00	MUFG UNION BANK NA FL.R 19-22 09/12Q	749,651.63	0.05
7,475,000.00	CREDIT SUISSE NEW YORK FL.R 21-23 09/08Q	7,405,300.49	0.49	3,300,000.00	NATL RURAL UTIL COOP FL.R 22-23 07/08Q	3,295,671.72	0.22
1,650,000.00	DAIMLER FIN NA LLC FL.R 18-23 04/05Q	1,651,716.91	0.11	2,450,000.00	NATL RURAL UTILITIES FL.R 21-24 18/10Q	2,385,797.75	0.16
2,100,000.00	DAIMLER TRUCKS FL.R 22-24 05/04Q	2,099,227.41	0.14	5,600,000.00	PPL ELECTRIC UTILITIES FL.R 21-24 24/06Q	5,534,421.48	0.37
5,000,000.00	DAIMLER TRUCKS FINA FL.R 21-24 13/12Q	4,945,007.75	0.33	3,000,000.00	PRINCIPAL LIFE GLOBAL FL.R 21-24 12/04Q	2,992,605.00	0.20
9,000,000.00	DAIMLER TRUCKS FINAN FL.R 21-23 14/12Q	8,954,452.80	0.59	5,500,000.00	QUALCOMM FL.R 17-23 30/01Q	5,507,842.73	0.36
6,320,000.00	DEUTSCHE BANK AG NEW FL.R 21-23 08/11Q	6,253,766.40	0.41	1,300,000.00	RABOBANK NY FL.R 18-23 10/01Q	1,300,304.27	0.09
8,200,000.00	DEUTSCHE BANK AG NY FL.R 21-27 16/11Q	7,284,634.00	0.48	7,000,000.00	ROCHE FL.R 22-23 11/09Q	6,981,973.25	0.46
4,650,000.00	DEUTSCHE BANK NY FL.R 17-22 16/11Q	4,645,017.29	0.31	8,500,000.00	ROCHE FL.R 22-25 10/03Q	8,452,872.60	0.56
3,260,000.00	DUPONT DE NEMOURS FL.R 18-23 15/11Q	3,274,720.85	0.22	2,450,000.00	ROCHE HOLDINGS INC FL.R 21-24 05/03Q	2,437,354.33	0.16
3,623,000.00	EBAY INC FL.R 17-23 30/01	3,625,806.56	0.24	1,815,000.00	SOUTH CALIFORNIA GAS FL.R 20-23 14/09Q	1,809,654.82	0.12
3,000,000.00	EVERSOURCE ENERGY FL.R 21-23 15/08Q	2,982,120.00	0.20	2,175,000.00	SPIRE MISSOURI FL.R 21-24 02/12Q	2,154,984.56	0.14
3,577,000.00	GENERAL MILLS INC FL.R 18-23 17/10Q	3,576,160.30	0.24	5,240,000.00	THERMO FISH SCIENTIFIC FL.R 21-23 18/10Q	5,201,302.60	0.34
1,200,000.00	GOLD SACH GR FL.R 22-25 24/01Q	1,179,084.30	0.08	9,500,000.00	THERMO FISHER SCIENTIF FL.R 21-23 18/04Q	9,480,781.50	0.63
3,000,000.00	GOLDMAN SACHS G FL.R 22-28 15/03Q	2,986,760.10	0.20	4,900,000.00	THERMO FISHER SCIENTIF FL.R 21-24 18/10Q	4,850,338.50	0.32
1,000,000.00	GOLDMAN SACHS G FL.R 22-28 24/02Q	961,010.15	0.06	4,000,000.00	TOYO MOTO FL.R 22-23 25/07M	4,007,210.00	0.27
2,441,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP FL.R 21-27 10/09Q	2,326,016.70	0.15	2,400,000.00	TOYOTA MOTOR CREDIT FL.R 22-2 22/03Q	2,398,317.96	0.16
8,928,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP FL.R 13-23 29/11Q	9,010,377.76	0.60	4,764,000.00	TOYOTA MOTOR CREDIT FL.R 21-23 13/02M	4,763,908.77	0.32
8,982,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP FL.R 18-26 15/05Q	8,901,484.90	0.59	3,482,000.00	TOYOTA MOTOR CREDIT FL.R 21-24 13/09Q	3,447,918.01	0.23
2,144,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP FL.R 22-24 15/03Q	2,146,621.04	0.14	7,500,000.00	TOYOTA MOTOR CREDIT FL.R 22-23 29/12Q	7,512,418.13	0.50
225,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP FL.R 21-27 21/10Q	214,398.79	0.01	7,500,000.00	TOYOTA MOTOR CREDIT FL.R 21-22 14/12M	7,500,472.88	0.50
500,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP FL.R 21-24 08/03Q	495,367.50	0.03	4,366,000.00	TOYOTA MOTOR CREDIT FL.R 21-24 11/01Q	4,341,602.79	0.29
200,000.00	GOLDMAN SACHS GROUP FL.R 21-24 21/10Q	196,261.30	0.01	2,285,000.00	TOYOTA MOTOR CREDIT FL.R 21-24 18/06Q	2,272,847.23	0.15

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets		
	USD			USD			
2,530,000.00	TOYOTA MOTOR CREDIT CO FL.R 22-25 13/01Q	2,501,894.87	0.17	4,366,000.00	HSBC HOLDINGS PLC FL.R 19-25 11/03Q	4,334,262.24	0.29
4,600,000.00	TOYOTA MOTOR CREDIT FL.R 21-23 06/04Q	4,594,201.24	0.30	20,302,000.00	HSBC HOLDINGS PLC FL.R 18-24 18/05Q	20,148,288.49	1.33
14,800,000.00	TRUIST BANK FL.R 21-24 17/01Q	14,662,582.00	0.96	4,400,000.00	HSBC HOLDINGS PLC FL.R 21-24 22/11Q	4,292,020.70	0.28
10,750,000.00	TRUIST FINANCIAL COR FL.R 21-25 07/06Q	10,529,114.37	0.70	3,000,000.00	NATIONWIDE BLDG FL.R 22-28 16/02Q	2,839,876.50	0.19
4,748,000.00	UNITED PARCEL SERV FL 17-23 01/04Q	4,752,472.14	0.31	8,669,000.00	NATWEST GROUP PLC FL.R 18-24 25/06Q	8,659,912.72	0.57
5,500,000.00	US BANK NATIONAL ASSOC FL.R 19-22 09/12Q	5,497,132.03	0.36	6,200,000.00	NATWEST MKTS AUTRE F.LR 22-25 22/03Q	6,169,698.12	0.41
4,236,000.00	VERIZON COMMUNICATIO FL.R 21-24 22/03Q	4,202,393.70	0.28	3,200,000.00	NATWEST MKTS FL.R 21-26 29/09Q	3,067,656.00	0.20
10,445,000.00	VERIZON COMMUNICATIO FL.R 21-26 22/03Q	10,286,665.29	0.68	2,750,000.00	STANDARD CHARTERED FL.R 22-26 30/03Q	2,729,860.38	0.18
16,589,000.00	VERIZON COMMUNICATION FL.R 18-25 15/05Q	16,682,270.00	1.09	5,895,000.00	STANDARD CHARTERED FL.R 21-25 23/11Q	5,732,902.24	0.38
	Finlande	2,485,750.75	0.16	5,500,000.00	STANDARD CHARTERED PLC FL.R 20-23 14/10Q	5,501,281.50	0.36
2,500,000.00	NORDEA BKP AUTRE V FL.R 22-25 06/06Q	2,485,750.75	0.16	3,000,000.00	UBS AG LONDON FL.R 22-25 13/01Q	2,958,132.75	0.20
	France	24,560,001.93	1.63	9,188,000.00	UBS AG LONDON BRANCH FL.R 21-23 01/06Q	9,173,852.77	0.61
10,500,000.00	BFCM FL.R 21-25 04/02Q	10,263,760.50	0.68	9,500,000.00	UBS AG LONDON BRANCH FL.R 21-24 09/02Q	9,456,537.50	0.63
3,928,000.00	BPCE FL.R 18-23 12/09Q	3,933,524.74	0.26	9,700,000.00	UBS AG LONDON FL.R 21-24 09/08Q	9,644,580.50	0.64
3,170,000.00	BPCE SA FL.R 22-25 14/01Q	3,119,405.69	0.21	4,485,000.00	VODAFONE GROUP FL.R 18-24 16/01Q	4,495,808.62	0.30
7,500,000.00	SOCIETE GENERALE SA FL.R 22-26 21/01Q	7,243,311.00	0.48		Singapour	2,005,731.70	0.13
	Irlande	4,911,203.75	0.33	2,000,000.00	UNITED OVERSEAS BANK FL.R 22-25 07/04Q	2,005,731.70	0.13
5,000,000.00	AERCAP IRELAND CAPITAL FL.R 21-23 29/09Q	4,911,203.75	0.33		Suède	11,135,333.46	0.74
	Japon	94,990,873.81	6.29	1,000,000.00	SKANDINAVISKA ENSK FL.R 20-33 01/09Q	994,779.20	0.07
6,490,000.00	MITSUBISHI UFJ FL.R 18-23 02/03Q	6,486,436.02	0.43	5,000,000.00	SKANDINAVISKA ENSKILD FL.R 22-25 09/06Q	4,973,513.50	0.33
3,000,000.00	MITSUBISHI UFJ FL.R 22-25 12/09Q	2,997,930.00	0.20	1,200,000.00	SVENSKA HANDELSBANKEN FL.R 22-25 10/06Q	1,193,546.76	0.08
16,454,000.00	MITSUBISHI UFJ FIN FL.R 18-23 26/07Q	16,471,446.99	1.09	4,000,000.00	SWEDBANK AB FL.R 22-25 04/04Q	3,973,494.00	0.26
4,000,000.00	MITSUBISHI UFJ FINANCI FL.R 22-25 18/07Q	4,023,690.40	0.27		Suisse	15,727,546.95	1.04
8,200,000.00	MIZUHO FINANCIAL FL.R 22-26 22/05Q	8,008,841.19	0.53	3,275,000.00	CREDIT SUISSE FL.R 17-23 14/12Q	3,270,183.13	0.22
10,826,000.00	MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 20-24 25/05Q	10,718,390.10	0.71	6,501,000.00	CREDIT SUISSE FL.R 18-24 12/06Q	6,489,613.82	0.42
2,200,000.00	MIZUHO FINANCIAL GRP FL.R 20-24 08/09Q	2,167,632.06	0.14	6,000,000.00	UBS GROUP FL.R 22-26 12/05Q	5,967,750.00	0.40
4,350,000.00	MIZUHO FINANCIAL GRP FL.R 20-24 10/07Q	4,342,670.03	0.29		Thaïlande	5,463,097.20	0.36
10,637,000.00	MIZUHO FINANCIAL GRP FL.R 18-23 05/03Q	10,642,012.68	0.70	5,500,000.00	JPMORGAN CHASE CO FL.R 21-24 16/03Q	5,463,097.20	0.36
1,045,000.00	MIZUHO FINANCIAL GRP FL.R 18-24 11/09Q	1,042,391.00	0.07		Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	4,997,345.00	0.33
7,000,000.00	SUMITOMO MITSUI FL.R 22-27 14/01Q	6,801,957.05	0.45		Obligations à taux flottant	4,997,345.00	0.33
1,500,000.00	SUMITOMO MITSUI FL.R 17-22 18/10Q	1,499,613.98	0.10		Etats-Unis d'Amérique	4,004,440.00	0.26
7,067,000.00	SUMITOMO MITSUI FINL FL.R 18-23 16/10Q	7,068,511.98	0.47	4,000,000.00	CITIGROUP FL.R 22-25 24/05Q	4,004,440.00	0.26
4,574,000.00	SUMITOMO MITSUI FINL FL.R 18-23 17/01Q	4,574,541.34	0.30		Singapour	992,905.00	0.07
5,663,000.00	SUMITOMO MITSUI FINL FL.R 18-23 19/07Q	5,669,333.49	0.38	1,000,000.00	DBS GROUP HOLDING FL.R 21-24 22/11Q	992,905.00	0.07
2,500,000.00	SUMITOMO TRUST AND FL.R 21-24 16/09Q	2,475,475.50	0.16		Autres valeurs mobilières	47,036,912.74	3.12
	Norvège	8,457,214.23	0.56		Obligations à taux flottant	47,036,912.74	3.12
8,000,000.00	DNB BANK A AUTRE R+ F.LR 22-25 28/03Q	7,957,792.40	0.53		Australie	26,563,319.63	1.76
500,000.00	DNB BANK ASA FL.R 19-22 02/12Q	499,421.83	0.03	4,000,000.00	AUSTRALIA NEW ZEA BAN FL.R 19-22 21/11	3,997,921.60	0.26
	Nouvelle Zélande	4,007,208.60	0.27	15,000,000.00	COMMONWEALTH BA FL.R 21-25 07/07Q	14,743,958.25	0.98
4,000,000.00	ASB BANK FL.R 18-23 14/06Q	4,007,208.60	0.27	3,500,000.00	COMMONWEALTH D'AUSTRAL FL.R 21-26 15/06Q	3,430,537.78	0.23
	Pays-Bas	22,157,380.50	1.47	4,500,000.00	MACQUARIE GROUP LTD 0.759 21-25 14/10Q	4,390,902.00	0.29
5,000,000.00	ING GROEP NV SOFFRAT F.LR 22-26 28/03Q	4,989,618.75	0.33		Canada	18,277,624.73	1.21
4,100,000.00	ING GROEP N.V./ING BAN FL.R 21-27 01/04Q	3,933,493.87	0.26	13,792,000.00	BANK OF MONTREAL FL.R 20-23 10/03Q	13,782,318.01	0.91
4,348,000.00	ING GROUP NV FL.R 18-23 02/10Q	4,353,988.06	0.29	4,500,000.00	TORONTO DOMINION BANK FL.R 21-23 06/01Q	4,495,306.72	0.30
8,900,000.00	SIEMENS FINANCIERING FL.R 21-24 11/03Q	8,880,279.82	0.59		Norvège	1,299,575.12	0.09
	Royaume-Uni	137,673,254.48	9.12	1,300,000.00	DNB BANK ASA FL.R 19-22 02/12Q	1,299,575.12	0.09
3,000,000.00	ANZ NEW ZEALAND INTL FL.R 22-25 18/02Q	2,972,145.00	0.20				
4,100,000.00	ASTRAZENECA PLC FL.R 18-23 17/08Q	4,103,841.29	0.27				
14,728,000.00	BARCLAYS PLC FL.R 18-24 16/05Q	14,650,987.29	0.97				
4,823,000.00	CREDIT AGRICOLE FL.R 18-23 24/04Q	4,829,546.74	0.32				
4,000,000.00	HSBC AUTRE FL.R 22-XX 10/3Q	3,944,134.00	0.26				
8,066,000.00	HSBC HOLDINGS PLC FL.R 18-26 12/09Q	7,967,929.13	0.53				

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité		Valeur d'évaluation	% actifs nets
		USD	
	Pays-Bas	496,836.01	0.03
500,000.00	SIEMENS FINANCIERING FL.R 21-24 11/03Q	496,836.01	0.03
	Suisse	399,557.25	0.03
400,000.00	CREDIT SUISSE GROUP FL.R 17-23 14/12Q	399,557.25	0.03
	Total portefeuille-titres	1,484,273,014.99	98.30

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	USD			USD	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	132,042,538.72	90.25	5,640,000.00 PHILIPPINES 3.2 21-46 06/07S	3,831,675.00	2.62
Obligations	132,042,538.72	90.25	Qatar	10,761,788.48	7.36
Afrique du Sud	4,998,235.24	3.42	5,756,000.00 QATAR 4.817 19-49 14/03S	5,317,322.29	3.63
2,796,000.00 SOUTH AFRICA 4.85 19-29 30/09S	2,315,258.84	1.58	5,652,000.00 QATAR 5.103 18-48 23/04S	5,444,466.19	3.73
4,168,000.00 SOUTH AFRICA 5.75 19-49 30/09S	2,682,976.40	1.84	Rép. Dominicaine	4,973,513.69	3.40
Arabie saoudite	17,760,228.37	12.13	3,430,000.00 DOMINICAN REPUBLIC 4.875 20-32 23/09S	2,590,250.25	1.77
9,389,000.00 ARABIE SAOUDITE 4.625 17-47 04/10S	7,979,476.38	5.45	3,568,000.00 DOMINICAN REPUBLIC 5.875 20-60 30/01S	2,383,263.44	1.63
10,322,000.00 SAUDI INTERNATIONA 3.625 17-28 04/03S	9,780,751.99	6.68	Roumanie	2,317,615.43	1.58
Bahreïn	4,951,931.83	3.38	1,340,000.00 ROMANIA 3.0000 22-27 27/02S	1,133,229.63	0.77
3,129,000.00 BAHRAIN 6.75 17-29 20/09S	2,930,723.09	2.00	2,092,000.00 ROMANIA 4.0000 20-51 14/02S	1,184,385.80	0.81
2,571,000.00 KINGDOM OF BAHR 5.6250 21-34 18/05S	2,021,208.74	1.38	Turquie	7,956,851.97	5.44
Brésil	7,098,305.82	4.85	9,304,000.00 TURKEY 7.625 19-29 26/04S	7,956,851.97	5.44
2,731,000.00 BRAZIL 2.8750 20-25 06/06S	2,567,512.10	1.75	Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	2,684,958.60	1.84
5,462,000.00 BRAZIL 3.875 20-30 12/06S	4,530,793.72	3.10	Obligations	2,684,958.60	1.84
Chine	3,354,374.78	2.29	Hongrie	1,595,025.28	1.09
2,062,000.00 CHINA 0.55 20-25 21/10S	1,844,899.75	1.26	2,300,000.00 HUNGARY GOVERNMENT 2.125 21-31 22/09S	1,595,025.28	1.09
1,850,000.00 CHINA 1.20 20-30 21/10S	1,509,475.03	1.03	Panama	1,089,933.32	0.75
Colombie	1,272,485.52	0.87	1,150,000.00 PANAMA GOVERNMENT 3.75 19-26 17/04S	1,089,933.32	0.75
1,724,000.00 COLOMBIA 6.125 09-41 18/01S	1,272,485.52	0.87	Autres valeurs mobilières	8,881,537.86	6.07
Egypte	6,035,750.67	4.13	Obligations	8,881,537.86	6.07
4,802,000.00 EGYPT 7.6250 20-32 29/05S	2,925,859.08	2.00	Turquie	8,881,537.86	6.07
5,538,000.00 EGYPT 8.875 20-50 29/05S	3,109,891.59	2.13	9,204,000.00 HAZINE MUSTESARLIGI 7.25 22-27 24/02S	8,881,537.86	6.07
Emirates arabes	13,250,135.86	9.06	Total portefeuille-titres	143,609,035.18	98.16
7,500,000.00 ARAB EMIRATES 3.875 20-50 16/04S	6,097,050.00	4.17			
7,672,000.00 EMIRATE OF ABU DHABI 3.125 17-27 11/10S	7,153,085.86	4.89			
Hongrie	1,021,889.82	0.70			
1,900,000.00 HUNGARY 3.1250 21-51 21/09S	1,021,889.82	0.70			
Indonésie	16,464,107.19	11.25			
10,969,000.00 INDONESIA 3.05 21-51 12/03S	7,324,489.42	5.01			
9,508,000.00 PERUS PE SBSN ID III TR 4.4 22-27 06/06S	9,139,617.77	6.24			
Mexique	8,321,303.83	5.69			
5,961,000.00 MEXICO 4.50 19-29 22/04S	5,539,595.15	3.79			
3,800,000.00 MEXICO 4.60 17-48 10/02S	2,781,708.68	1.90			
Nigéria	2,768,633.51	1.89			
2,300,000.00 NIGERIA 7.3750 21-33 28/09S	1,399,176.37	0.95			
2,441,000.00 NIGERIA 7.625 17-47 28/11S	1,369,457.14	0.94			
Oman	6,511,247.98	4.45			
3,490,000.00 OMAN 5.625 18-28 17/01S	3,258,370.97	2.23			
4,029,000.00 OMAN 6.75 18-48 17/01S	3,252,877.01	2.22			
Panama	1,070,380.09	0.73			
1,300,000.00 REPUBLIQUE DU PANAMA 3.362 21-31 30/06S	1,070,380.09	0.73			
Pérou	2,788,710.62	1.91			
3,390,000.00 PERU 2.844 19-30 20/06S	2,788,710.62	1.91			
Philippines	8,365,048.02	5.72			
5,016,000.00 PHILIPPINES 3.00 18-28 01/02S	4,533,373.02	3.10			

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	270,856,651.94	88.67	1,617,000.00 GERMANY 0.00 21-31 15/08A	1,351,812.00	0.44
Obligations	270,856,651.94	88.67	1,264,700.00 GERMANY 0.00 21-36 15/05A	931,704.49	0.31
Allemagne	54,215,744.73	17.75	Autriche	8,343,580.06	2.73
1,513,330.00 ALLEMAGNE 0.25 17-27 15/02A	1,410,877.56	0.46	641,000.00 AUSTRIA 0.75 18-28 20/02A	584,463.80	0.19
1,841,740.00 BUNDESREPUB. DE 0.0000 19-29 15/08A	1,606,365.63	0.53	596,000.00 AUSTRIA 0.5 19-29 20/02A	522,990.00	0.17
325,000.00 BUNDESREPUBLIK DEUT 1.0 22-38 15/05A	270,140.00	0.09	1,246,000.00 AUSTRIA 0.50 17-27 20/04A	1,147,067.60	0.37
375,000.00 BUNDESREPUBLIK DEUTS 0.0 21-31 15/08A	314,396.25	0.10	850,000.00 AUSTRIA 0.75 16-26 20/10A	794,580.00	0.26
1,493,300.00 BUNDESREPUBLIK DEUTS 0.0 22-23 15/02A	1,229,284.56	0.40	565,000.00 AUSTRIA 1.20 15-25 20/10A	547,372.00	0.18
379,000.00 BUNDESREPUBLIK DEUTSCH 1.7 22-32 15/08A	364,484.30	0.12	444,000.00 AUSTRIA 1.50 16-47 20/02A	334,110.00	0.11
588,100.00 BUNDESSCHATZANW 0.00 21-23 15/12A	577,014.32	0.19	111,000.00 AUSTRIA 1.50 16-86 02/11A	67,520.19	0.02
999,300.00 BUNDESSCHATZANWEISU 0.0 22-04 15/03A	976,176.20	0.32	609,000.00 AUSTRIA 1.65 14-24 21/10A	603,579.90	0.20
188,000.00 BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0.4 22-24 13/09A	183,074.40	0.06	528,000.00 AUSTRIA 1.75 13-23 20/10A	527,461.44	0.17
858,900.00 BUNDSOBLIGATION 0.0 22-27 16/04A	784,605.15	0.26	406,000.00 AUSTRIA 2.40 13-34 23/05A	385,630.98	0.13
172,000.00 BUNDSOBLIGATION 1.3 22-27 15/10A	166,564.80	0.05	179,000.00 AUSTRIA 3.80 12-62 26/01A	216,677.71	0.07
1,005,000.00 BUNDSOBLIGATION 0.0 18-23 13/10A	986,508.00	0.32	748,000.00 AUSTRIA 4.15 06-37 15/03A	850,730.32	0.28
511,000.00 FEDERAL GERMANY 0.2 22-24 14/06A	498,250.55	0.16	96,000.00 AUSTRIA 4.85 09-26 15/03A	104,678.40	0.03
772,900.00 GERMANY 0.00 21-52 15/08A	411,105.51	0.13	235,000.00 AUSTRIA GOVERNMENT BON 0.00 22-28 20/10A	201,371.50	0.07
514,000.00 GERMANY 0.0 20-30 15/08A	439,521.40	0.14	226,000.00 AUSTRIA 0.00 20-40 20/10A	131,125.20	0.04
1,422,000.00 GERMANY 0.00 16-26 15/08U	1,325,872.80	0.43	397,000.00 AUSTRIA 0.00 21-25 20/04A	375,998.70	0.12
1,188,010.00 GERMANY 0.00 19-24 25/01A	1,158,666.15	0.38	178,000.00 AUSTRIA 0.70 21-71 20/04A	81,274.80	0.03
1,656,800.00 GERMANY 0.00 19-50 15/08U	919,855.36	0.30	70,000.00 AUSTRIA 0.85 30/06 20-2120A	26,747.00	0.01
881,450.00 GERMANY 0.00 19-24 18/10A	851,524.77	0.28	651,000.00 REPUBLIC OF AUS 0.0000 19-24 15/07A	629,829.48	0.21
1,109,060.00 GERMANY 0.00 20-27 15/11U	1,005,141.08	0.33	304,000.00 REPUBLIC OF AUS 0.2500 21-36 20/10A	210,371.04	0.07
474,000.00 GERMANY 0.00 21-50 15/08A	264,823.80	0.09	Belgique	8,503,845.76	2.78
188,000.00 GERMANY 0.0000 20-30 15/08A	160,834.00	0.05	564,000.00 BELGIUM 0.00 21-31 22/10U	444,714.00	0.15
1,488,850.00 GERMANY 0.25 18-28 15/08A	1,349,046.99	0.44	494,000.00 BELGIUM 0.20 16-23 22/10A	486,096.00	0.16
1,432,290.00 GERMANY 0.25 19-29 11/01A	1,283,904.75	0.42	442,000.00 BELGIUM 0.80 15-25 22/06A	429,270.40	0.14
1,782,000.00 GERMANY 0.5 18-28 15/02A	1,651,914.00	0.54	814,000.00 BELGIUM 0.80 17-27 22/06A	762,148.20	0.25
1,358,773.00 GERMANY 0.50 15-25 15/02A	1,320,727.36	0.43	1,011,000.00 BELGIUM 1.00 16-26 22/06A	971,672.10	0.32
1,409,000.00 GERMANY 0.50 16-26 15/02A	1,348,976.60	0.44	554,400.00 BELGIUM 1.25 18-33 22/04A	479,666.88	0.16
1,418,324.00 GERMANY 0.50 17-27 15/08A	1,325,281.94	0.43	369,100.00 BELGIUM 2.15 16-66 22/06A	303,178.74	0.10
1,137,885.00 GERMANY 1.00 14-24 15/08A	1,124,457.96	0.37	601,000.00 BELGIUM 2.60 14-24 22/06A	609,053.40	0.20
3,579,000.00 GERMANY 1.00 15-25 15/08A	3,503,841.00	1.16	480,600.00 BELGIUM 3.00 14-34 22/06A	484,540.92	0.16
1,521,100.00 GERMANY 1.25 17-48 15/08A	1,257,949.70	0.41	470,300.00 BELGIUM 3.75 13-45 22/06A	517,047.82	0.17
1,105,500.00 GERMANY 1.50 14-24 15/05A	1,103,952.30	0.36	427,800.00 BELGIUM 4.00 12-32 28/03A	473,916.84	0.16
1,112,153.00 GERMANY 1.75 14-24 15/02A	1,112,964.87	0.36	852,900.00 BELGIUM 4.25 10-41 28/03A	976,911.66	0.31
1,521,000.00 GERMANY 2.50 14-46 15/08A	1,623,971.70	0.53	244,600.00 BELGIUM 4.50 11-26 28/03A	264,559.36	0.09
1,408,200.00 GERMANY 2.50 12-44 04/07A	1,486,073.46	0.49	971,800.00 BELGIUM 5.00 04-35 28/03A	1,170,824.64	0.37
979,800.00 GERMANY 3.25 10-42 04/07A	1,140,683.16	0.37	112,000.00 BELGIUM OLO 5.50 98-28 28/03A	130,244.80	0.04
1,405,300.00 GERMANY 4.00 05-37 04/01A	1,702,661.48	0.56	Espagne	38,857,670.57	12.72
530,400.00 GERMANY 4.25 07-39 04/07A	676,472.16	0.22	1,492,000.00 SPAIN 5.75 01-32 30/07A	1,812,705.40	0.59
525,000.00 GERMANY 4.75 03-34 04/07A	664,072.50	0.22	817,000.00 SPAIN 6.00 98-29 31/01A	964,550.20	0.32
1,095,100.00 GERMANY 4.75 08-40 04/07A	1,493,497.38	0.49	745,000.00 SPAIN 0.25 19-24 30/07A	719,334.75	0.24
584,800.00 GERMANY 4.75 98-28 04/07A	667,549.20	0.22	299,000.00 SPAIN GOVERNMENT 0.80 22-29 30/07A	259,546.95	0.08
43,000.00 GERMANY 5.50 00-31 04/01A	54,162.80	0.02	384,000.00 SPAIN GOVERNMENT BOND 1.9 22-52 31/10A	258,163.20	0.08
484,000.00 GERMANY 5.625 98-28 04/01A	570,055.20	0.19	1,166,000.00 SPAIN 0.00 20-25 31/01U	1,106,359.10	0.36
482,641.00 GERMANY 6.25 00-30 04/01A	620,164.72	0.20	596,000.00 SPAIN 0.1 21-31 30/04A	462,436.40	0.15
1,353,000.00 GERMANY 0.00 20-25 10/10A	1,277,637.90	0.42	1,099,000.00 SPAIN 0.5 21-31 31/10A	870,408.00	0.28
162,000.00 GERMANY 0.00 20-25 11/04A	155,098.80	0.05	54,000.00 SPAIN 0.50 20-30 30/04A	45,073.80	0.01
935,900.00 GERMANY 0.00 20-30 15/02A	809,366.32	0.26	547,000.00 SPAIN 0.60 19-29 31/10A	466,536.30	0.15
2,003,400.00 GERMANY 0.00 20-35 15/05A	1,507,758.84	0.49	449,000.00 SPAIN 0.80 20-27 30/07A	410,857.45	0.13
846,000.00 GERMANY 0.00 21-26 09/10A	784,834.20	0.26	982,000.00 SPAIN 1.30 16-26 31/10A	939,332.10	0.31
377,000.00 GERMANY 0.00 21-26 10/04A	354,116.10	0.12	3,103,000.00 SPAIN 1.40 18-28 30/04A	2,882,066.40	0.95
1,518,100.00 GERMANY 0.00 21-28 15/11A	1,345,947.46	0.44	336,000.00 SPAIN 1.40 18-28 30/07A	310,346.40	0.10
3,217,000.00 GERMANY 0.00 21-31 15/02A	2,710,000.80	0.90	553,000.00 SPAIN 1.45 17-27 31/10A	520,207.10	0.17

Quantité		Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité		Valeur d'évaluation	% actifs nets
		EUR				EUR	
612,000.00	SPAIN 1.45 19-29 29/01A	560,959.20	0.18	2,052,200.00	FRANCE 0.0000 19-29 25/11A	1,732,467.24	0.57
295,000.00	SPAIN 1.45 21-71 31/10A	145,140.00	0.05	2,490,000.00	FRANCE 0.0000 20-30 25/11A	2,037,318.00	0.67
460,000.00	SPAIN 1.50 17-27 30/04A	437,667.00	0.14	1,999,000.00	FRANCE 0.25 15-26 25/11A	1,848,675.20	0.61
1,601,000.00	SPAIN 1.60 15-25 30/04A	1,575,384.00	0.52	2,532,000.00	FRANCE 0.5 18-29 25/05A	2,243,858.40	0.73
932,000.00	SPAIN 1.85 19-35 05/03A	777,940.40	0.25	2,433,000.00	FRANCE 0.50 15-26 25/05A	2,297,725.20	0.75
2,089,000.00	SPAIN 1.95 15-30 30/07A	1,936,711.90	0.63	1,256,990.00	FRANCE 0.50 20-40 25/05A	821,065.87	0.27
1,695,000.00	SPAIN 1.95 16-26 30/04A	1,668,049.50	0.55	777,870.00	FRANCE 0.50 21-44 25/06A	472,478.24	0.15
1,706,000.00	SPAIN 2.15 15-25 31/10A	1,693,802.10	0.55	2,129,000.00	FRANCE 0.50 15-25 25/05A	2,048,204.45	0.67
824,000.00	SPAIN 2.35 17-33 30/07A	753,712.80	0.25	231,800.00	FRANCE 0.50 21-72 25/05A	89,405.26	0.03
845,000.00	SPAIN 2.70 18-48 31/10A	712,926.50	0.23	2,718,000.00	FRANCE 0.75 17-28 25/05A	2,491,318.80	0.82
1,231,000.00	SPAIN 2.75 14-24 31/10A	1,245,772.00	0.41	2,621,000.00	FRANCE 0.75 17-28 25/11A	2,382,489.00	0.78
935,000.00	SPAIN 2.90 16-46 31/10A	830,747.50	0.27	1,197,000.00	FRANCE 0.75 21-53 25/05A	658,469.70	0.22
731,000.00	SPAIN 3.45 16-66 30/07A	679,391.40	0.22	1,918,000.00	FRANCE 1.00 15-25 25/11A	1,857,007.60	0.61
1,375,000.00	SPAIN 3.80 14-24 30/04A	1,408,756.25	0.46	1,615,500.00	FRANCE 1.00 16-27 25/05A	1,528,586.10	0.50
1,287,000.00	SPAIN 4.20 05-37 31/01A	1,391,504.40	0.46	2,182,300.00	FRANCE 1.25 16-36 25/05A	1,768,754.15	0.58
1,037,000.00	SPAIN 4.40 13-23 31/10A	1,061,369.50	0.35	1,996,000.00	FRANCE 1.25 18-34 25/05A	1,679,634.00	0.55
739,000.00	SPAIN 4.65 10-25 30/07A	785,667.85	0.26	2,526,000.00	FRANCE 1.50 15-31 25/05A	2,338,318.20	0.77
1,049,000.00	SPAIN 4.70 09-41 30/07A	1,209,287.20	0.40	1,689,200.00	FRANCE 1.50 18-50 25/05A	1,210,142.88	0.40
434,000.00	SPAIN 4.80 08-24 31/01A	449,334.52	0.15	1,486,000.00	FRANCE 1.75 13-24 25/11A	1,480,501.80	0.48
653,000.00	SPAIN 4.90 07-40 30/07A	772,303.10	0.25	707,200.00	FRANCE 1.75 15-66 25/05A	496,737.28	0.16
3,146,000.00	SPAIN 5.15 13-28 31/10A	3,542,396.00	1.17	1,488,000.00	FRANCE 1.75 17-39 25/06A	1,249,176.00	0.41
775,000.00	SPAIN 5.15 13-44 31/10A	956,350.00	0.31	1,496,700.00	FRANCE 2.00 17-48 25/05A	1,222,654.24	0.40
1,795,000.00	SPAIN 5.90 11-26 30/07A	2,017,580.00	0.67	1,865,100.00	FRANCE 2.25 13-24 25/05A	1,876,383.86	0.61
339,000.00	SPGB 1.00 21-42 30/07A	216,993.90	0.07	2,850,000.00	FRANCE 2.50 13-30 25/05A	2,877,360.00	0.95
Finlande		3,398,025.42	1.11	2,611,900.00	FRANCE 2.75 12-27 25/10A	2,670,145.37	0.88
2,000.00	FINLAND 0.000 20-30 15/09A	1,625.00	0.00	1,364,500.00	FRANCE 3.25 12-45 25/05A	1,412,121.05	0.46
33,000.00	FINLAND 0.125 20-36 15/04A	22,941.60	0.01	2,234,000.00	FRANCE 3.50 10-26 25/04A	2,340,561.80	0.77
69,000.00	FINLAND 0.5 18-28 04/09A	61,396.20	0.02	987,800.00	FRANCE 4.00 04-55 25/04A	1,168,863.74	0.38
705,000.00	FINLAND 0.5 19-29 15/09A	614,266.50	0.20	796,000.00	FRANCE 4.00 09-60 25/04A	968,891.20	0.32
240,000.00	FINLAND 0.50 16-26 15/04A	226,764.00	0.07	2,270,000.00	FRANCE 4.25 06-23 25/10A	2,326,795.40	0.76
269,000.00	FINLAND 0.50 17-27 15/09A	245,623.90	0.08	1,899,000.00	FRANCE 4.50 09-41 25/04A	2,272,343.40	0.74
48,000.00	FINLAND 0.75 15-31 15/04A	41,059.20	0.01	1,928,889.00	FRANCE 5.00 98-29 25/04A	2,282,068.57	0.75
348,000.00	FINLAND 0.875 15-25 15/09A	335,023.08	0.11	1,333,500.00	FRANCE 5.75 00-32 25/10A	1,683,277.06	0.55
506,000.00	FINLAND 1.125 18-34 15/04A	419,575.20	0.14	1,480,000.00	FRANCE 6.00 94-25 25/10A	1,651,088.00	0.54
202,000.00	FINLAND 1.375 17-47 15/04A	155,560.20	0.05	Irlande		5,725,963.51	1.87
186,000.00	FINLAND 2.00 14-24 15/04A	186,548.70	0.06	460,000.00	IRELAND 0.00 21-31 18/10A	364,642.00	0.12
261,000.00	FINLAND 2.625 12-42 04/07A	251,134.20	0.08	261,000.00	IRELAND 0.20 20-27 15/05A	238,214.70	0.08
269,000.00	FINLAND 2.75 12-28 04/07A	273,223.30	0.09	268,100.00	IRELAND 0.40 20-35 15/05A	199,761.31	0.07
294,000.00	FINLAND 4.00 09-25 04/07A	309,629.04	0.10	205,500.00	IRELAND 0.55 21-41 22/04A	132,424.20	0.04
25,000.00	FINLAND REGS 0.000 19-24 15/09A	24,084.00	0.01	306,000.00	IRELAND 0.90 18-28 15/05A	281,673.00	0.09
287,000.00	FINLAND 0.125 21-31 15/09A	229,571.30	0.08	1,251,000.00	IRELAND 1.00 16-26 15/05A	1,202,836.50	0.39
France		76,891,637.35	25.18	115,000.00	IRELAND 1.10 19-29 16/01A	105,800.00	0.03
753,000.00	FRANCE 0.7500 22-28 25/02A	692,308.20	0.23	242,000.00	IRELAND 1.30 18-33 15/05A	209,402.60	0.07
1,200,900.00	FRANCE 4.00 06-38 25/10A	1,342,366.02	0.44	126,000.00	IRELAND 1.35 18-31 18/03A	115,138.80	0.04
1,434,000.00	FRANCE 4.75 04-35 25/04A	1,699,720.20	0.56	354,000.00	IRELAND 1.50 19-50 15/05A	255,198.60	0.08
894,000.00	FRANCE GOVERNMENT 2.0 22-32 25/11A	836,426.40	0.27	317,000.00	IRELAND 1.70 17-37 15/05A	269,037.90	0.09
1,232,300.00	FRANCE GOVERNMENT BOND 0.00 22-25 25/02A	1,175,429.36	0.38	506,000.00	IRELAND 2.00 15-45 18/02A	420,081.20	0.14
146,000.00	FRANCE GOVT BOND OAT 1.25 22-38 25/05A	113,807.00	0.04	1,253,000.00	IRELAND 2.40 14-30 15/05A	1,251,245.80	0.41
1,762,000.00	FRANCE (GOVT OF 0.0000 22-32 25/05A	1,368,545.40	0.45	336,000.00	IRELAND 3.40 14-24 18/03A	343,408.80	0.11
1,642,400.00	FRANCE ZCP 290420	924,835.44	0.30	126,000.00	IRELAND 5.40 09-25 13/03A	136,136.70	0.04
2,169,000.00	FRANCE 0.0 18-24 25/03A	2,109,938.13	0.69	253,100.00	IRISH GOVERNMENT 0.3500 22-32 18/10A	200,961.40	0.07
2,349,150.00	FRANCE 0.00 19-25 25/03A	2,238,152.66	0.73	Italie		54,542,408.81	17.86
2,302,000.00	FRANCE 0.00 20-26 25/02A	2,146,384.80	0.70	645,000.00	BUONI POLIENNAL 1.5000 21-45 30/04S	380,034.00	0.12
1,296,290.00	FRANCE 0.00 21-24 25/02A	1,263,766.08	0.41	213,000.00	BUONI POLIENNAL 2.1500 21-72 01/03S	126,522.00	0.04
1,883,000.00	FRANCE 0.00 21-27 25/02A	1,709,387.40	0.56	744,000.00	BUONI POLIENNAL 3.8500 18-49 01/09S	677,932.80	0.22
2,255,220.00	FRANCE 0.00 21-31 25/11A	1,785,683.20	0.58	944,000.00	BUONI POLIENNALI TES 2.45 20-50 01/09S	654,286.40	0.21

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité		Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité		Valeur d'évaluation	% actifs nets
		EUR				EUR	
316,000.00	ITALIE 0.00 21-26 01/04U	280,197.20	0.09	686,000.00	NETHERLANDS 0.00 20-30 15/07A	576,610.44	0.19
331,000.00	ITALIE 2.95 17-38 01/09S	273,207.40	0.09	674,800.00	NETHERLANDS 0.00 20-52 15/01A	342,636.45	0.11
120,000.00	ITALY 1.75 19-24 01/07S	117,780.00	0.04	672,000.00	NETHERLANDS 0.00 21-31 15/07A	552,115.20	0.18
131,000.00	ITALY 2.8 22-29 15/06S	121,240.50	0.04	392,800.00	NETHERLANDS 0.00 21-38 15/01A	266,283.05	0.09
313,000.00	ITALY 21-24 15/08U	296,786.60	0.10	768,000.00	NETHERLANDS 0.25 15-25 15/07A	733,601.28	0.24
731,000.00	ITALY 0.00 20-24 15/01S	706,416.47	0.23	529,600.00	NETHERLANDS 0.25 19-29 14/02A	464,618.08	0.15
708,000.00	ITALY 0.00 21-24 15/04S	678,972.00	0.22	1,716,000.00	NETHERLANDS 0.50 16-26 15/07A	1,621,860.24	0.54
1,346,000.00	ITALY 0.65 16-23 15/10S	1,323,750.62	0.43	751,160.00	NETHERLANDS 0.50 19-40 15/01A	534,818.41	0.18
688,000.00	ITALY 0.95 20-27 15/09S	603,032.00	0.20	173,000.00	NETHERLANDS 0.75 17-27 15/07A	162,064.67	0.05
60,000.00	ITALY 0.95 20-30 01/08S	47,178.00	0.02	800,000.00	NETHERLANDS 2.00 14-24 15/07A	803,848.00	0.26
854,000.00	ITALY 1.25 16-26 01/12S	780,043.60	0.26	722,000.00	NETHERLANDS 2.50 12-33 15/01A	724,758.04	0.24
385,000.00	ITALY 1.35 19-30 01/04S	317,317.00	0.10	960,200.00	NETHERLANDS 2.75 14-47 15/01A	1,020,433.35	0.33
2,058,000.00	ITALY 1.45 20-36 01/03S	1,447,391.40	0.47	925,900.00	NETHERLANDS 3.75 10-42 15/01A	1,100,209.93	0.36
2,959,000.00	ITALY 1.60 16-26 01/06S	2,775,837.90	0.91	1,054,651.00	NETHERLANDS 5.50 98-28 15/01A	1,230,197.66	0.40
1,393,000.00	ITALY 1.65 15-32 01/03S	1,107,713.60	0.36	939,000.00	ROYAUME PAYS-BAS 0.75 18-28 15/07A	868,152.45	0.28
650,000.00	ITALY 1.70 20-51 01/09S	379,600.00	0.12				
4,314,000.00	ITALY 2.00 15-25 01/12S	4,146,616.80	1.36		Portugal	6,201,031.03	2.03
719,000.00	ITALY 2.00 18-28 01/02S	657,669.30	0.22	162,700.00	OBRIGACOES DO T 1.1500 22-42 11/04A	108,130.42	0.04
859,000.00	ITALY 2.05 17-27 01/08S	797,495.60	0.26	308,400.00	PORTUGAL 0.30 21-31 17/10A	240,151.08	0.08
1,074,000.00	ITALY 2.20 17-27 01/06S	1,008,163.80	0.33	211,000.00	PORTUGAL 0.90 20-35 12/10A	157,511.50	0.05
1,478,000.00	ITALY 2.25 16-36 01/09S	1,148,258.20	0.38	201,000.00	PORTUGAL 0.475 20-30 18/10A	165,021.00	0.05
316,000.00	ITALY 2.45 16-33 01/09S	260,447.20	0.09	335,000.00	PORTUGAL 0.70 20-27 15/10A	304,883.50	0.10
985,000.00	ITALY 2.45 18-23 01/08S	985,985.00	0.32	168,000.00	PORTUGAL 1.00 21-52 12/04A	87,007.20	0.03
646,000.00	ITALY 2.70 16-47 01/03S	485,856.60	0.16	345,000.00	PORTUGAL 1.95 19-29 15/06A	328,336.50	0.11
1,277,000.00	ITALY 2.80 18-28 01/08S	1,202,550.90	0.39	541,000.00	PORTUGAL 2.125 18-28 17/10A	522,876.50	0.17
494,000.00	ITALY 2.80 16-67 01/03S	349,752.00	0.11	524,000.00	PORTUGAL 2.25 18-34 18/04A	476,840.00	0.16
1,276,000.00	ITALY 3.00 19-29 01/02S	1,201,098.80	0.39	653,000.00	PORTUGAL 2.875 15-25 15/10A	667,300.70	0.22
737,000.00	ITALY 3.25 14-46 01/09S	613,331.40	0.20	824,000.00	PORTUGAL 2.875 16-26 21/07A	842,128.00	0.27
521,000.00	ITALY 3.35 19-35 01/06S	464,263.10	0.15	916,000.00	PORTUGAL 3.875 14-30 15/02A	979,112.40	0.31
924,000.00	ITALY 3.45 17-48 01/03S	790,759.20	0.26	499,000.00	PORTUGAL 4.10 06-37 15/04A	539,319.20	0.18
374,000.00	ITALY 3.50 14-30 01/03S	361,545.80	0.12	189,000.00	PORTUGAL 4.10 15-45 15/02A	207,011.70	0.07
911,000.00	ITALY 3.75 14-24 01/09S	925,484.90	0.30	557,500.00	PORTUGAL 4.95 08-23 25/10A	575,401.33	0.19
793,000.00	ITALY 4.00 05-37 01/02S	757,473.60	0.25				
5,532,000.00	ITALY 4.50 10-26 01/03S	5,742,216.00	1.89		Valeurs mobilières négociées sur un autre marché	23,998,279.39	7.86
960,000.00	ITALY 4.50 13-24 01/03S	983,059.20	0.32		réglementé		
631,000.00	ITALY 4.75 13-28 01/09S	659,773.60	0.22		Obligations	23,998,279.39	7.86
910,000.00	ITALY 4.75 13-44 01/09S	944,671.00	0.31				
1,628,000.00	ITALY 5.00 03-34 01/08S	1,705,004.40	0.56		Autriche	975,032.30	0.32
418,000.00	ITALY 5.00 07-39 01/08S	442,996.40	0.15	401,000.00	AUSTRIA 0.9 22-32 20/02A	338,002.90	0.11
3,360,000.00	ITALY 5.00 09-25 01/03S	3,505,488.00	1.15	182,000.00	AUSTRIA GOVERNMENT 1.85 22-49 23/05A	149,403.80	0.05
1,735,000.00	ITALY 5.00 09-40 01/09S	1,837,191.50	0.60	616,000.00	AUSTRIA 0.00 21-31 20/02A	487,625.60	0.16
3,863,000.00	ITALY 5.25 98-29 01/11S	4,179,766.00	1.37				
1,163,000.00	ITALY 5.75 02-33 01/02S	1,287,092.10	0.42		Belgique	8,512,081.95	2.79
231,000.00	ITALY 7.25 96-26 01/11S	265,003.20	0.09	433,800.00	BELGIUM 1.4 22-53 22/06A	284,616.18	0.09
547,000.00	ITALY 9.00 93-23 01/11S	584,939.92	0.19	146,500.00	BELGIUM 0.0000 20-27 22/10A	130,516.85	0.04
1,615,000.00	ITALY BTP 6.50 97-27 01/11S	1,828,018.50	0.60	295,000.00	BELGIUM 0.1000 20-30 22/06A	246,502.00	0.08
486,000.00	ITALY TB 2.10 19-26 15/07S	462,866.40	0.15	390,900.00	BELGIUM 0.4000 20-40 22/06A	249,159.66	0.08
453,000.00	ITALY TREASURY BONDS 2.15 22-52 01/09S	288,470.40	0.09	1,485,000.00	BELGIUM 0.50 17-24 22/10A	1,446,761.25	0.48
905,000.00	ITALY 0.95 21-37 01/03S	573,860.50	0.19	2,407,000.00	BELGIUM 0.80 18-28 22/06A	2,210,829.50	0.73
	Pays-Bas	14,176,744.70	4.64	760,100.00	BELGIUM 0.9 19-29 22/06A	688,878.63	0.23
788,000.00	NETHERLANDS 0.00 17-24 15/01U	770,530.04	0.25	1,081,800.00	BELGIUM 1.00 15-31 22/06A	951,010.38	0.31
866,700.00	NETHERLANDS 4.00 05-37 15/01A	1,009,601.49	0.33	303,000.00	BELGIUM 1.45 17-37 22/06A	245,733.00	0.08
331,000.00	NETHERLANDS GOV 0.0000 22-26 15/01A	310,137.07	0.10	533,900.00	BELGIUM 1.60 16-47 22/06A	400,478.39	0.13
534,200.00	NETHERLANDS GOV 0.5000 22-32 15/07A	444,977.92	0.15	540,200.00	BELGIUM 1.7 19-50 05/02A	399,207.80	0.13
401,000.00	NETHERLANDS GOVERNMENT 0.0 21-29 15/01A	348,537.17	0.11	432,600.00	BELGIUM 1.90 15-38 22/06A	370,046.04	0.12
318,000.00	NETHERLANDS 0.00 20-27 15/01A	290,753.76	0.10	327,800.00	BELGIUM 2.25 17-57 22/06A	275,909.26	0.09
				618,100.00	BELGIUM KINGDOM 0.35 22-32 22/06A	491,451.31	0.16
				280,700.00	BELGIUM 0.65 21-71 22/06A	120,981.70	0.04

Quantité		Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité		Valeur d'évaluation	% actifs nets
		EUR				EUR	
	Espagne	856,418.15	0.28	205,000.00	FINNISH GOVERNMENT 0.5000 22-43 15/04A	130,954.00	0.04
285,000.00	SPAIN 0.00 21-27 31/01A	254,362.50	0.08	Total portefeuille-titres			
217,000.00	SPAIN 0.00 20-26 31/01A	200,410.35	0.07			302,063,689.87	98.89
581,000.00	SPAIN 0.85 21-37 30/07A	401,645.30	0.13				
	Finlande	466,931.36	0.15				
511,000.00	FINLAND 0.0021-26 15/09A	466,931.36	0.15				
	Italie	12,261,080.18	4.02				
943,000.00	BUONI POLIENNAL 0.0000 21-24 30/01S	910,617.38	0.31				
739,000.00	BUONI POLIENNAL 0.0000 22-23 29/11S	717,790.70	0.23				
969,000.00	BUONI POLIENNAL 0.8500 19-27 15/01S	865,704.60	0.29				
611,000.00	ITALIAN REPUBLIC 0.45 21-29 15/02S	490,694.10	0.16				
748,000.00	ITALY 1.1 22-27 01/04S	669,310.40	0.22				
671,000.00	ITALY 0.25 21-28 15/03S	553,239.50	0.18				
125,000.00	ITALY 0.5 21-28 15/07S	103,212.50	0.03				
2,648,000.00	ITALY 0.6 21-31 01/08S	1,930,921.60	0.64				
98,000.00	ITALY 0.90 20-31 01/04S	74,715.20	0.02				
1,040,000.00	ITALY 0.95 21-31 01/12S	774,592.00	0.25				
2,416,000.00	ITALY 1.65 20-30 01/12S	1,992,475.20	0.66				
880,000.00	ITALY 1.80 20-41 01/03S	586,080.00	0.19				
478,000.00	ITALY 1.85 17-24 15/05S	470,447.60	0.15				
550,000.00	ITALY 3.10 19-40 01/03S	456,720.00	0.15				
169,000.00	ITALY 6.00 00-31 01/05S	191,122.10	0.06				
316,000.00	ITALY BUO POL DEL TE 2.5 22-32 01/12S	265,155.60	0.09				
803,000.00	ITALY BUONI POL TESORO 0.95 21-32 01/06S	587,715.70	0.19				
47,000.00	ITALY BUONI POLIENN 3.25 22-38 01/03S	40,274.30	0.01				
180,000.00	ITALY BUONI POLIENNAL 2.65 22-27 01/12S	169,776.00	0.06				
469,000.00	REPUBLIQUE ITALIENNE 0.00 21-26 01/08S	410,515.70	0.13				
	Portugal	926,735.45	0.30				
135,000.00	PORTUGAL 1.65 22-32 16/07A	117,382.50	0.04				
458,400.00	PORTUGAL 4.125 17-27 14/04A	490,671.36	0.16				
304,100.00	PORTUGAL 5.65 13-24 15/02A	318,681.59	0.10				
	Autres valeurs mobilières	7,208,758.54	2.36				
	Obligations	7,208,758.54	2.36				
	Autriche	1,363,491.74	0.45				
575,000.00	AUSTRIA 0.00 20-30 20/02A	473,685.00	0.16				
368,000.00	AUSTRIA 0.75 20-51 20/03A	218,040.00	0.07				
393,000.00	AUSTRIA 2.10 17-17 20/09A	285,042.90	0.09				
368,000.00	AUSTRIA 3.15 12-44 20/06A	386,723.84	0.13				
	Espagne	5,309,835.80	1.73				
1,173,000.00	BONOS Y OBLIG D 0.7000 22-32 30/04A	931,948.50	0.30				
482,000.00	PAIN GOVERNMENT BOND 2.55 22-32 31/10A	451,682.20	0.15				
1,082,000.00	SECRETAR A GENERAL 1.2 20-40 31/10A	740,953.60	0.24				
1,459,000.00	SPAIN (BON.ESTATADO) 1.25 20-30 31/10A	1,273,852.90	0.41				
65,000.00	SPAIN GOVERNMENT BOND 0.0 22-25 31/05A	61,067.50	0.02				
733,000.00	SPAIN 0.00 21-24 31/05A	707,418.30	0.23				
740,000.00	SPAIN 0.00 21-28 31/01A	638,916.00	0.21				
928,000.00	SPAIN 1.00 20-50 31/10A	503,996.80	0.17				
	Finlande	535,431.00	0.18				
161,000.00	FINLAND 1.5000 22-32 15/09A	143,032.40	0.05				
207,000.00	FINLAND 0.125 21-52 15/04A	101,223.00	0.03				
252,000.00	FINLAND 0.25 20-40 15/09A	160,221.60	0.06				

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	339,903,456.86	75.00	2,796,000.00 SPAIN 5.15 13-28 31/10A	3,148,296.00	0.69
Obligations	339,903,456.86	75.00	2,254,000.00 SPAIN 5.15 13-44 31/10A	2,781,436.00	0.61
			3,414,000.00 SPAIN 5.90 11-26 30/07A	3,837,336.00	0.86
			952,000.00 SPGB 1.00 21-42 30/07A	609,375.20	0.13
Belgique	61,734,402.01	13.62	Irlande	34,481,249.19	7.61
3,964,700.00 BELGIUM 0.00 21-31 22/10U	3,126,165.95	0.69	2,742,200.00 IRELAND 0.00 21-31 18/10A	2,173,741.94	0.48
2,619,500.00 BELGIUM 0.20 16-23 22/10A	2,577,588.00	0.57	2,160,900.00 IRELAND 0.20 20-27 15/05A	1,972,253.43	0.44
6,390,500.00 BELGIUM 0.80 15-25 22/06A	6,206,453.60	1.37	2,410,300.00 IRELAND 0.20 20-30 18/10A	2,012,118.44	0.44
4,409,100.00 BELGIUM 0.80 17-27 22/06A	4,128,240.33	0.91	1,598,900.00 IRELAND 0.40 20-35 15/05A	1,191,340.39	0.26
4,728,000.00 BELGIUM 1.00 16-26 22/06A	4,544,080.80	1.00	1,232,000.00 IRELAND 0.55 21-41 22/04A	793,900.80	0.18
3,171,600.00 BELGIUM 1.25 18-33 22/04A	2,744,068.32	0.61	2,383,900.00 IRELAND 0.90 18-28 15/05A	2,194,379.95	0.48
2,273,600.00 BELGIUM 2.15 16-66 22/06A	1,867,535.04	0.41	3,265,000.00 IRELAND 1.00 16-26 15/05A	3,139,297.50	0.69
4,321,200.00 BELGIUM 2.60 14-24 22/06A	4,379,104.08	0.97	3,047,600.00 IRELAND 1.10 19-29 16/01A	2,803,792.00	0.62
2,697,600.00 BELGIUM 3.00 14-34 22/06A	2,719,720.32	0.60	1,453,400.00 IRELAND 1.30 18-33 15/05A	1,257,627.02	0.28
2,905,000.00 BELGIUM 3.75 13-45 22/06A	3,193,757.00	0.70	1,880,300.00 IRELAND 1.35 18-31 18/03A	1,718,218.14	0.38
2,728,100.00 BELGIUM 4.00 12-32 28/03A	3,022,189.18	0.67	2,063,600.00 IRELAND 1.50 19-50 15/05A	1,487,649.24	0.33
4,923,500.00 BELGIUM 4.25 10-41 28/03A	5,639,376.90	1.24	1,918,600.00 IRELAND 1.70 17-37 15/05A	1,628,315.82	0.36
3,531,300.00 BELGIUM 4.50 11-26 28/03A	3,819,454.08	0.84	3,023,400.00 IRELAND 2.00 15-45 18/02A	2,510,026.68	0.55
5,737,400.00 BELGIUM 5.00 04-35 28/03A	6,912,419.52	1.53	2,640,800.00 IRELAND 2.40 14-30 15/05A	2,637,102.88	0.58
5,894,100.00 BELGIUM OLO 5.50 98-28 28/03A	6,854,248.89	1.51	2,321,200.00 IRELAND 3.40 14-24 18/03A	2,372,382.46	0.52
Espagne	110,626,703.08	24.41	3,334,900.00 IRELAND 5.40 09-25 13/03A	3,603,192.70	0.80
3,468,000.00 SPAIN 5.75 01-32 30/07A	4,213,446.60	0.94	1,241,700.00 IRELAND 5.40 09-25 13/03A	3,603,192.70	0.80
3,608,300.00 SPAIN 6.00 98-29 31/01A	4,259,958.98	0.95	1,241,700.00 IRISH GOVERNMENT 0.3500 22-32 18/10A	985,909.80	0.22
2,633,000.00 SPAIN 0.25 19-24 30/07A	2,542,293.15	0.56	Italie	97,215,458.28	21.45
1,169,000.00 SPAIN GOVERNMENT 0.80 22-29 30/07A	1,014,750.45	0.22	1,258,000.00 BUONI POLIENNAL 1.5000 21-45 30/04S	741,213.60	0.16
1,268,000.00 SPAIN GOVERNMENT BOND 1.9 22-52 31/10A	852,476.40	0.19	500,000.00 BUONI POLIENNAL 2.1500 21-72 01/03S	297,000.00	0.07
3,186,000.00 SPAIN 0.00 20-25 31/01U	3,023,036.10	0.67	1,423,000.00 BUONI POLIENNAL 3.8500 18-49 01/09S	1,296,637.60	0.29
3,454,000.00 SPAIN 0.1 21-31 30/04A	2,679,958.60	0.59	1,473,000.00 BUONI POLIENNALI TES 2.45 20-50 01/09S	1,020,936.30	0.23
3,031,000.00 SPAIN 0.5 21-31 31/10A	2,400,552.00	0.53	2,081,000.00 ITALIE 0.00 21-26 01/04U	1,845,222.70	0.41
3,172,000.00 SPAIN 0.50 20-30 30/04A	2,647,668.40	0.58	1,166,000.00 ITALIE 1.45 25 15-03S	1,114,229.60	0.25
3,300,000.00 SPAIN 0.60 19-29 31/10A	2,814,570.00	0.62	1,497,000.00 ITALIE 2.95 17-38 01/09S	1,235,623.80	0.27
3,240,000.00 SPAIN 0.80 20-27 30/07A	2,964,762.00	0.65	1,461,000.00 ITALY 1.75 19-24 01/07S	1,433,971.50	0.32
3,708,000.00 SPAIN 1.30 16-26 31/10A	3,546,887.40	0.78	924,000.00 ITALY 2.8 22-29 15/06S	855,162.00	0.19
3,573,000.00 SPAIN 1.40 18-28 30/04A	3,318,602.40	0.73	1,362,000.00 ITALY 21-24 15/08U	1,291,448.40	0.28
3,275,000.00 SPAIN 1.40 18-28 30/07A	3,024,953.75	0.67	1,498,000.00 ITALY 0.00 20-24 15/01S	1,447,622.26	0.32
3,214,000.00 SPAIN 1.45 17-27 31/10A	3,023,409.80	0.67	1,501,000.00 ITALY 0.00 21-24 15/04S	1,439,459.00	0.32
3,173,000.00 SPAIN 1.45 19-29 29/01A	2,908,371.80	0.64	1,966,000.00 ITALY 0.65 16-23 15/10S	1,933,502.02	0.43
940,000.00 SPAIN 1.45 21-71 31/10A	462,480.00	0.10	2,014,000.00 ITALY 0.95 20-27 15/09S	1,765,271.00	0.39
3,540,000.00 SPAIN 1.50 17-27 30/04A	3,368,133.00	0.74	1,887,000.00 ITALY 0.95 20-30 01/08S	1,483,748.10	0.33
3,141,000.00 SPAIN 1.60 15-25 30/04A	3,090,744.00	0.68	2,038,000.00 ITALY 1.25 16-26 01/12S	1,861,509.20	0.41
3,279,000.00 SPAIN 1.85 19-35 05/03A	2,736,981.30	0.60	2,373,000.00 ITALY 1.35 19-30 01/04S	1,955,826.60	0.43
3,604,000.00 SPAIN 1.95 15-30 30/07A	3,341,268.40	0.74	1,442,000.00 ITALY 1.45 20-36 01/03S	1,014,158.60	0.22
3,009,000.00 SPAIN 1.95 16-26 30/04A	2,961,156.90	0.65	1,951,000.00 ITALY 1.50 15-25 01/06S	1,865,351.10	0.41
3,706,000.00 SPAIN 2.15 15-25 31/10A	3,679,502.10	0.81	2,263,000.00 ITALY 1.60 16-26 01/06S	2,122,920.30	0.47
2,674,000.00 SPAIN 2.35 17-33 30/07A	2,445,907.80	0.54	2,524,000.00 ITALY 1.65 15-32 01/03S	2,007,084.80	0.44
2,589,000.00 SPAIN 2.70 18-48 31/10A	2,184,339.30	0.48	1,639,000.00 ITALY 1.70 20-51 01/09S	957,176.00	0.21
3,454,000.00 SPAIN 2.75 14-24 31/10A	3,495,448.00	0.77	2,044,000.00 ITALY 2.00 15-25 01/12S	1,964,692.80	0.43
2,607,000.00 SPAIN 2.90 16-46 31/10A	2,316,319.50	0.51	2,178,000.00 ITALY 2.00 18-28 01/02S	1,992,216.60	0.44
2,091,000.00 SPAIN 3.45 16-66 30/07A	1,943,375.40	0.43	1,978,000.00 ITALY 2.05 17-27 01/08S	1,836,375.20	0.41
2,941,000.00 SPAIN 3.80 14-24 30/04A	3,013,201.55	0.66	1,775,000.00 ITALY 2.20 17-27 01/06S	1,666,192.50	0.37
3,159,000.00 SPAIN 4.20 05-37 31/01A	3,415,510.80	0.75	1,558,000.00 ITALY 2.25 16-36 01/09S	1,210,410.20	0.27
3,137,000.00 SPAIN 4.40 13-23 31/10A	3,210,719.50	0.71	1,879,000.00 ITALY 2.45 16-33 01/09S	1,548,671.80	0.34
3,601,000.00 SPAIN 4.65 10-25 30/07A	3,828,403.15	0.85	1,697,000.00 ITALY 2.45 18-23 01/08S	1,698,697.00	0.37
3,198,000.00 SPAIN 4.70 09-41 30/07A	3,686,654.40	0.82	2,126,000.00 ITALY 2.50 14-24 01/12S	2,105,803.00	0.46
2,535,000.00 SPAIN 4.80 08-24 31/01A	2,624,569.15	0.58	1,674,000.00 ITALY 2.70 16-47 01/03S	1,259,015.40	0.28
2,714,000.00 SPAIN 4.90 07-40 30/07A	3,209,847.80	0.71	2,217,000.00 ITALY 2.80 18-28 01/08S	2,087,748.90	0.46
			871,000.00 ITALY 2.80 16-67 01/03S	616,668.00	0.14

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
2,049,000.00 ITALY 3.00 19-29 01/02S	1,928,723.70	0.43	2,431,200.00 BELGIUM 1.90 15-38 22/06A	2,079,648.48	0.46
1,639,000.00 ITALY 3.25 14-46 01/09S	1,363,975.80	0.30	1,861,000.00 BELGIUM 2.25 17-57 22/06A	1,566,403.70	0.35
1,480,000.00 ITALY 3.35 19-35 01/06S	1,318,828.00	0.29	3,848,800.00 BELGIUM KINGDOM 0.35 22-32 22/06A	3,060,180.88	0.68
1,839,000.00 ITALY 3.45 17-48 01/03S	1,573,816.20	0.35	1,504,300.00 BELGIUM 0.65 21-71 22/06A	648,353.30	0.14
2,441,000.00 ITALY 3.50 14-30 01/03S	2,359,714.70	0.52	Espagne	6,552,323.05	1.45
2,109,000.00 ITALY 3.75 14-24 01/09S	2,142,533.10	0.47	2,660,000.00 SPAIN 0.00 21-27 31/01A	2,374,050.00	0.52
2,605,000.00 ITALY 4.00 05-37 01/02S	2,488,296.00	0.55	3,075,000.00 SPAIN 0.00 20-26 31/01A	2,839,916.25	0.63
2,346,000.00 ITALY 4.50 10-26 01/03S	2,435,148.00	0.54	1,936,000.00 SPAIN 0.85 21-37 30/07A	1,338,356.80	0.30
2,324,000.00 ITALY 4.50 13-24 01/03S	2,379,822.48	0.53	Italie	37,754,510.42	8.33
2,488,000.00 ITALY 4.75 13-28 01/09S	2,601,452.80	0.57	1,385,000.00 BUONI POLIENNAL 0.0000 21-24 15/12S	1,298,437.50	0.29
1,705,000.00 ITALY 4.75 13-44 01/09S	1,769,960.50	0.39	1,457,000.00 BUONI POLIENNAL 0.0000 21-24 30/01S	1,406,966.62	0.31
2,372,000.00 ITALY 5.00 03-34 01/08S	2,484,195.60	0.55	1,741,000.00 BUONI POLIENNAL 0.0000 22-23 29/11S	1,691,033.30	0.37
2,276,000.00 ITALY 5.00 07-39 01/08S	2,412,104.80	0.53	1,880,000.00 BUONI POLIENNAL 0.5000 20-26 01/02S	1,709,296.00	0.38
2,568,000.00 ITALY 5.00 09-25 01/03S	2,679,194.40	0.59	1,912,000.00 BUONI POLIENNAL 0.8500 19-27 15/01S	1,708,180.80	0.38
2,142,000.00 ITALY 5.00 09-40 01/09S	2,268,163.80	0.50	1,164,000.00 BUONI POLIENNAL 1.2000 22-25 15/08S	1,096,022.40	0.24
2,905,200.00 ITALY 5.25 98-29 01/11S	3,143,426.40	0.69	1,636,000.00 ITALIAN REPUBLIC 0.45 21-29 15/02S	1,313,871.60	0.29
2,027,000.00 ITALY 5.75 02-33 01/02S	2,243,280.90	0.49	1,731,000.00 ITALY 1.45 17-24 15/10S	1,679,762.40	0.37
1,239,200.00 ITALY 7.25 96-26 01/11S	1,421,610.24	0.31	1,226,000.00 ITALY 1.1 22-27 01/04S	1,097,024.80	0.24
1,233,100.00 ITALY 9.00 93-23 01/11S	1,318,627.81	0.29	1,723,000.00 ITALY 1.8500 20-25 01/07S	1,657,870.60	0.37
2,651,300.00 ITALY BTP 6.50 97-27 01/11S	3,001,006.47	0.66	1,929,000.00 ITALY 0.25 21-28 15/03S	1,590,460.50	0.35
1,677,000.00 ITALY TB 2.10 19-26 15/07S	1,597,174.80	0.35	2,079,000.00 ITALY 0.3500 19-25 01/02S	1,952,388.90	0.43
908,000.00 ITALY TREASURY BONDS 2.15 22-52 01/09S	578,214.40	0.13	1,549,000.00 ITALY 0.5 21-28 15/07S	1,279,009.30	0.28
1,647,000.00 ITALY 0.95 21-37 01/03S	1,044,362.70	0.23	2,126,000.00 ITALY 0.6 21-31 01/08S	1,550,279.20	0.34
1,732,000.00 REPUBLIQUE ITALIENNE 2.5 18-25 15/11S	1,690,258.80	0.37	2,339,000.00 ITALY 0.90 20-31 01/04S	1,783,253.60	0.39
Portugal	35,845,644.30	7.91	1,968,000.00 ITALY 0.95 21-31 01/12S	1,465,766.40	0.32
894,400.00 OBRIGACOES DO T 1.1500 22-42 11/04A	594,418.24	0.13	2,309,000.00 ITALY 1.65 20-30 01/12S	1,904,232.30	0.42
2,307,300.00 PORTUGAL 0.30 21-31 17/10A	1,796,694.51	0.40	1,659,000.00 ITALY 1.80 20-41 01/03S	1,104,894.00	0.24
1,691,200.00 PORTUGAL 0.90 20-35 12/10A	1,262,480.80	0.28	1,026,000.00 ITALY 1.85 17-24 15/05S	1,009,789.20	0.22
3,200,500.00 PORTUGAL 0.475 20-30 18/10A	2,627,610.50	0.58	1,321,000.00 ITALY 3.10 19-40 01/03S	1,096,958.40	0.24
1,798,700.00 PORTUGAL 0.70 20-27 15/10A	1,636,996.87	0.36	2,953,000.00 ITALY 6.00 00-31 01/05S	3,339,547.70	0.75
949,700.00 PORTUGAL 1.00 21-52 12/04A	491,849.63	0.11	1,127,000.00 ITALY BUO POL DEL TE 2.5 22-32 01/12S	945,665.70	0.21
3,545,800.00 PORTUGAL 1.95 19-29 15/06A	3,374,537.86	0.74	1,796,000.00 ITALY BUONI POL TESORO 0.95 21-32 01/06S	1,314,492.40	0.29
4,561,700.00 PORTUGAL 2.125 18-28 17/10A	4,408,883.05	0.98	625,000.00 ITALY BUONI POLIENN 3.25 22-38 01/03S	535,562.50	0.12
2,415,200.00 PORTUGAL 2.25 18-34 18/04A	2,197,832.00	0.48	729,000.00 ITALY BUONI POLIENNAL2.65 22-27 01/12S	687,592.80	0.15
4,056,000.00 PORTUGAL 2.875 15-25 15/10A	4,144,826.40	0.91	1,755,000.00 REPUBLIQUE ITALIENNE 0.00 21-26 01/08S	1,536,151.50	0.34
3,383,800.00 PORTUGAL 2.875 16-26 21/07A	3,458,243.60	0.76	Portugal	7,114,741.63	1.57
2,044,200.00 PORTUGAL 3.875 14-30 15/02A	2,185,045.38	0.48	866,000.00 PORTUGAL 1.65 22-32 16/07A	752,987.00	0.17
2,958,000.00 PORTUGAL 4.10 06-37 15/04A	3,197,006.40	0.71	2,999,900.00 PORTUGAL 4.125 17-27 14/04A	3,211,092.96	0.70
1,193,600.00 PORTUGAL 4.10 15-45 15/02A	1,307,350.08	0.29	3,006,500.00 PORTUGAL 5.65 13-24 15/02A	3,150,661.67	0.70
3,063,500.00 PORTUGAL 4.95 08-23 25/10A	3,161,868.98	0.70	Autres valeurs mobilières	17,738,103.20	3.91
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	91,350,861.46	20.16	Obligations	17,738,103.20	3.91
Obligations	91,350,861.46	20.16	Espagne	17,738,103.20	3.91
Belgique	39,929,286.36	8.81	3,220,000.00 BONOS Y OBLIG D 0.7000 22-32 30/04A	2,558,290.00	0.56
2,772,700.00 BELGIUM 1.4 22-53 22/06A	1,819,168.47	0.40	2,239,000.00 PAIN GOVERNMENT BOND 2.55 22-32 31/10A	2,098,166.90	0.46
2,692,200.00 BELGIUM 0.0000 20-27 22/10A	2,398,480.98	0.53	2,531,000.00 SECRETAR A GENERAL 1.2 20-40 31/10A	1,733,228.80	0.38
3,793,900.00 BELGIUM 0.1000 20-30 22/06A	3,170,182.84	0.70	3,521,000.00 SPAIN (BON.ESTATADO) 1.25 20-30 31/10A	3,074,185.10	0.68
2,507,200.00 BELGIUM 0.4000 20-40 22/06A	1,598,089.28	0.35	1,627,000.00 SPAIN GOVERNMENT BOND 0.0 22-25 31/05A	1,528,566.50	0.34
3,719,700.00 BELGIUM 0.50 17-24 22/10A	3,623,917.73	0.80	2,900,000.00 SPAIN 0.00 21-24 31/05A	2,798,790.00	0.62
4,488,000.00 BELGIUM 0.80 18-28 22/06A	4,122,228.00	0.91	2,822,000.00 SPAIN 0.00 21-28 31/01A	2,436,514.80	0.54
5,523,300.00 BELGIUM 0.9 19-29 22/06A	5,005,766.79	1.09	2,781,000.00 SPAIN 1.00 20-50 31/10A	1,510,361.10	0.33
4,928,500.00 BELGIUM 1.00 15-31 22/06A	4,332,644.35	0.96	Total portefeuille-titres	448,992,421.52	99.07
2,103,700.00 BELGIUM 1.45 17-37 22/06A	1,706,100.70	0.38			
3,303,600.00 BELGIUM 1.60 16-47 22/06A	2,478,030.36	0.55			
3,139,500.00 BELGIUM 1.7 19-50 05/02A	2,320,090.50	0.51			

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	EUR			EUR	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	83,147,961.07	74.50	Portugal	4,836,079.66	4.33
Obligations	83,147,961.07	74.50	4,614,800.00 PORTUGAL 5.65 13-24 15/02A	4,836,079.66	4.33
Belgique	19,926,224.46	17.86	Autres valeurs mobilières	5,050,807.50	4.53
3,839,800.00 BELGIUM 0.20 16-23 22/10A	3,778,363.20	3.39	Obligations	5,050,807.50	4.53
9,772,800.00 BELGIUM 0.80 15-25 22/06A	9,491,343.36	8.51	Espagne	5,050,807.50	4.53
6,568,500.00 BELGIUM 2.60 14-24 22/06A	6,656,517.90	5.96	2,094,000.00 SPAIN GOVERNMENT BOND 0.0 22-25 31/05A	1,967,313.00	1.76
Espagne	27,965,172.93	25.05	3,195,000.00 SPAIN 0.00 21-24 31/05A	3,083,494.50	2.77
2,903,000.00 SPAIN 0.25 19-24 30/07A	2,802,991.65	2.51	Total portefeuille-titres	110,180,879.32	98.73
3,508,000.00 SPAIN 0.00 20-25 31/01U	3,328,565.80	2.98			
3,567,000.00 SPAIN 1.60 15-25 30/04A	3,509,928.00	3.15			
3,975,000.00 SPAIN 2.75 14-24 31/10A	4,022,700.00	3.60			
3,475,000.00 SPAIN 3.80 14-24 30/04A	3,560,311.25	3.19			
3,457,000.00 SPAIN 4.40 13-23 31/10A	3,538,239.50	3.17			
3,969,000.00 SPAIN 4.65 10-25 30/07A	4,219,642.35	3.78			
2,881,000.00 SPAIN 4.80 08-24 31/01A	2,982,794.38	2.67			
Irlande	9,022,371.46	8.09			
3,513,900.00 IRELAND 3.40 14-24 18/03A	3,591,381.49	3.22			
5,026,600.00 IRELAND 5.40 09-25 13/03A	5,430,989.97	4.87			
Italie	21,451,497.69	19.21			
1,416,000.00 ITALIE 1.45 25 15-03S	1,353,129.60	1.21			
1,506,000.00 ITALY 1.75 19-24 01/07S	1,478,139.00	1.32			
1,251,000.00 ITALY 21-24 15/08U	1,186,198.20	1.06			
1,375,000.00 ITALY 0.00 20-24 15/01S	1,328,758.75	1.19			
1,681,000.00 ITALY 0.00 21-24 15/04S	1,612,079.00	1.44			
1,605,000.00 ITALY 0.65 16-23 15/10S	1,578,469.35	1.41			
1,849,000.00 ITALY 1.50 15-25 01/06S	1,767,828.90	1.58			
1,517,000.00 ITALY 2.45 18-23 01/08S	1,518,517.00	1.36			
1,965,000.00 ITALY 2.50 14-24 01/12S	1,946,332.50	1.74			
1,822,000.00 ITALY 3.75 14-24 01/09S	1,850,969.80	1.66			
2,138,000.00 ITALY 4.50 13-24 01/03S	2,189,354.76	1.97			
2,363,000.00 ITALY 5.00 09-25 01/03S	2,465,317.90	2.22			
1,100,100.00 ITALY 9.00 93-23 01/11S	1,176,402.93	1.05			
Portugal	4,782,694.53	4.29			
4,633,900.00 PORTUGAL 4.95 08-23 25/10A	4,782,694.53	4.29			
Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	21,982,110.75	19.70			
Obligations	21,982,110.75	19.70			
Belgique	5,487,170.85	4.92			
5,632,200.00 BELGIUM 0.50 17-24 22/10A	5,487,170.85	4.92			
Italie	11,658,860.24	10.45			
1,267,000.00 BUONI POLIENNAL 0.0000 21-24 15/12S	1,187,812.50	1.06			
1,404,000.00 BUONI POLIENNAL 0.0000 21-24 30/01S	1,355,786.64	1.21			
1,411,000.00 BUONI POLIENNAL 0.0000 22-23 29/11S	1,370,504.30	1.23			
1,151,000.00 BUONI POLIENNAL 1.2000 22-25 15/08S	1,083,781.60	0.97			
1,589,000.00 ITALY 1.45 17-24 15/10S	1,541,965.60	1.38			
1,605,000.00 ITALY 1.8500 20-25 01/07S	1,544,331.00	1.38			
1,765,000.00 ITALY 0.3500 19-25 01/02S	1,657,511.50	1.50			
1,337,000.00 ITALY 1.85 17-24 15/05S	1,315,875.40	1.18			
613,000.00 ITALY BUO POLI DEL T 1.75 22-24 30/05S	601,291.70	0.54			

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	USD			USD	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	58,891,591.79	98.78			
Obligations	58,891,591.79	98.78			
Etats-Unis d'Amérique	58,891,591.79	98.78			
608,100.00 ETATS-UNIS D'AMERIQUE 1.25 19-24 31/08S	574,987.07	0.96	415,000.00 UNITED STATES 2.125 17-24 29/02S	402,744.55	0.68
741,100.00 UNITED STATES 1.5 22-25 15/02S	694,897.08	1.17	415,000.00 UNITED STATES 2.125 17-24 30/11S	396,908.61	0.67
889,000.00 UNITED STATES 0.375 21-23 31/10S	852,259.32	1.43	1,072,400.00 UNITED STATES 2.125 17-24 31/03S	1,038,719.99	1.73
830,000.00 UNITED STATES 0.75 21-23 31/12S	794,854.73	1.33	978,100.00 UNITED STATES 2.25 14-24 15/11S	938,593.95	1.57
415,000.00 UNITED STATES 2.125 17-24 30/09S	398,464.86	0.67	415,000.00 UNITED STATES 2.25 17-24 31/10S	398,626.96	0.67
741,000.00 UNITED STATES 2.25 22-24 31/03S	719,059.43	1.21	415,000.00 UNITED STATES 2.25 17-24 31/12S	397,524.60	0.67
830,000.00 UNITED STATES -23 15/12S	790,121.08	1.33	608,000.00 UNITED STATES 2.25 19-24 30/04S	588,905.03	0.99
622,000.00 UNITED STATES 3.125 22-25 15/08S	602,805.45	1.01	608,000.00 UNITED STATES 2.375 20-25 31/01S	569,667.49	0.96
593,000.00 UNITED STATES 2.875 18-23 30/11S	583,410.06	0.98	978,200.00 UNITED STATES 2.375 14-24 15/08S	945,032.96	1.59
607,200.00 UNITED STATES 1.75 19-24 31/07S	580,445.24	0.97	608,000.00 UNITED STATES 2.375 19-24 29/02S	592,135.03	0.99
607,900.00 UNITED STATES 1.75 19-24 30/06S	582,254.22	0.98	978,200.00 UNITED STATES 2.50 14-24 15/05S	950,535.32	1.59
539,000.00 UNITED STATES 2.75 18-23 31/08S	531,841.43	0.89	608,000.00 UNITED STATES 2.500 19-24 31/01S	603,845.03	1.00
142,300.00 UNITED STATES 7.50 94-24 15/11S	151,660.66	0.25	608,100.00 UNITED STATES 2.625 18-23 31/12S	595,985.49	1.00
825,100.00 UNITED STATES OF AMER 0.125 21-23 31/08S	694,609.99	1.33	430,000.00 UNITED STATES 2.625 18-25 31/03S	413,606.25	0.69
608,100.00 UNITED STATES OF AMER 1.500 19-24 30/09S	576,649.86	0.97	445,000.00 UNITED STATES 2.75 18-25 30/06S	427,756.25	0.72
652,000.00 UNITED STATES OF AMER 2.875 22-25 15/06S	628,874.41	1.05	978,000.00 UNITED STATES 2.75 13-23 15/11S	961,343.48	1.61
682,000.00 UNITED STATES TREA 2.625 22-25 15/04S	655,092.99	1.10	430,000.00 UNITED STATES 2.75 18-25 28/02S	415,185.17	0.70
711,100.00 UNITED STATES TREASU 1.75 22-25 15/03S	669,933.99	1.12	978,000.00 UNITED STATES 2.750 14-24 15/02S	978,370.36	1.61
711,000.00 UNITED STATES TREASURY 2.5 22-24 30/04S	691,503.03	1.16	563,000.00 UNITED STATES 2.875 18-23 30/09S	555,698.62	0.93
667,000.00 UNITED STATES TREASURY 2.75 22-25 15/05S	641,935.41	1.08	578,000.00 UNITED STATES 2.875 18-23 31/10S	569,284.86	0.95
637,000.00 UNITED STATES TREASURY3.00 22-25 15/07S	615,700.32	1.03	430,000.00 UNITED STATES 2.875 18-25 30/04S	415,521.08	0.70
741,000.00 UNITED STATES 0.125 20-23 15/09S	712,807.24	1.20	445,000.00 UNITED STATES 2.875 18-25 31/07S	428,729.69	0.72
771,100.00 UNITED STATES 0.125 20-23 15/10S	738,689.74	1.24	140,500.00 UNITED STATES 7.625 95-25 15/02S	151,059.46	0.25
860,000.00 UNITED STATES 0.125 21-24 15/01S	815,454.67	1.37	415,000.00 US T NOTES 2.125 16-23 30/11S	415,000.00	0.68
860,000.00 UNITED STATES 0.125 21-24 15/02S	812,632.83	1.36	415,100.00 US TREASURY 2.125 17-24 31/07S	399,468.92	0.67
889,000.00 UNITED STATES 0.25 21-23 30/09S	854,204.01	1.43	697,000.00 US TREASURY 2.5000 22-24 31/05S	676,961.25	1.14
800,000.00 UNITED STATES 0.25 20-23 15/11S	764,687.52	1.28	415,000.00 US TREASURY N/B 1.375 16-23 30/09S	403,295.71	0.68
697,000.00 UNITED STATES 0.25 20-25 30/06S	625,666.44	1.05	859,100.00 US TREASURY N/B 0.5000 21-23 30/11S	822,454.05	1.38
667,000.00 UNITED STATES 0.25 20-25 31/05S	599,987.38	1.01	830,100.00 US TREASURY N/B 0.7500 21-24 15/11S	771,603.94	1.29
860,000.00 UNITED STATES 0.25 21-24 15/05S	805,981.25	1.35	800,000.00 US TREASURY N/B 0.8750 22-24 31/01S	764,562.48	1.28
860,000.00 UNITED STATES 0.25 21-24 15/06S	803,360.92	1.35	800,100.00 US TREASURY N/B 1.0000 21-24 15/12S	746,093.25	1.25
726,000.00 UNITED STATES 0.2500 20-25 31/07S	648,975.97	1.09	771,100.00 US TREASURY N/B 1.1250 22-25 15/01S	718,629.04	1.21
860,000.00 UNITED STATES 0.2521-24 15/03S	811,289.08	1.36	771,000.00 US TREASURY N/B 1.5000 22-24 29/02S	741,726.13	1.24
637,000.00 UNITED STATES 0.375 20-25 30/04S	576,982.69	0.97	682,000.00 US TREASURY N/B 3.0000 22-24 30/06S	667,294.38	1.12
859,900.00 UNITED STATES 0.375 21-24 15/04S	809,918.31	1.36	667,000.00 US TREASURY N/B 3.0000 22-24 31/07S	652,200.93	1.09
859,100.00 UNITED STATES 0.375 21-24 15/07S	802,453.09	1.35	652,000.00 US TREASURY N/B 3.2500 22-24 31/08S	640,335.33	1.07
859,200.00 UNITED STATES 0.375 21-24 15/08S	799,458.79	1.34	415,000.00 US TREASURY NOTE 1.625 16-23 31/10S	403,360.53	0.68
859,200.00 UNITED STATES 0.3750 21-24 15/09S	797,377.90	1.34	445,000.00 US TREASURY NOTES 2.875 18-25 31/05S	429,390.24	0.72
608,000.00 UNITED STATES 0.50 20-25 31/03S	554,942.52	0.93	166,000.00 USA TREASURY BONDS 6.875 95-25 15/08S	177,477.34	0.30
859,100.00 UNITED STATES 0.625 21-24 15/10S	798,761.63	1.34	415,000.00 USA TREASURY BONDS 2.5 18-25 31/01S	398,853.93	0.67
608,100.00 UNITED STATES 1.125 20-25 28/02S	564,915.42	0.95	415,000.00 USA TREASURY NOTES 2.25 17-24 31/01S	404,171.12	0.68
415,000.00 UNITED STATES 1.375 16-23 31/08S	404,300.80	0.68			
608,100.00 UNITED STATES 1.50 19-24 30/11S	573,894.38	0.96	Valeurs mobilières négociées sur un autre marché réglementé	404,884.38	0.68
608,100.00 UNITED STATES 1.5000 19-24 31/10S	575,272.09	0.96	Obligations	404,884.38	0.68
608,000.00 UNITED STATES 1.75 19-24 31/12S	576,460.00	0.97	Etats-Unis d'Amérique	404,884.38	0.68
415,000.00 UNITED STATES 1.875 17-24 31/08S	397,070.71	0.67	415,000.00 US TREASURY N/B 2.25 17-23 31/12S	404,884.38	0.68
978,100.00 UNITED STATES 2.00 15-25 15/02S	928,583.69	1.56			
978,000.00 UNITED STATES 2.00 15-25 15/08S	918,861.61	1.54	Total portefeuille-titres	59,296,476.17	99.46
415,100.00 UNITED STATES 2.00 17-24 30/04S	400,539.08	0.67			
415,100.00 UNITED STATES 2.00 17-24 30/06S	399,306.73	0.67			
1,072,200.00 UNITED STATES 2.00 17-24 31/05S	1,032,913.94	1.72			
978,000.00 UNITED STATES 2.125 15-25 15/05	926,807.86	1.55			

Portefeuille-Titres au 30/09/22

Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets	Quantité	Valeur d'évaluation	% actifs nets
	USD			USD	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs	16,512,475.79	98.56	261,300.00 UNITED STATES 2.25 15-25 15/11S	246,111.93	1.47
Obligations	16,512,475.79	98.56	249,400.00 UNITED STATES 2.25 17-27 15/08S	229,272.64	1.37
Etats-Unis d'Amérique	16,512,475.79	98.56	249,400.00 UNITED STATES 2.25 17-27 15/11S	228,220.48	1.36
178,000.00 UNIT ST 3.125 22-27 31/08S	170,754.85	1.02	127,300.00 UNITED STATES 2.25 19-26 31/03S	119,284.08	0.71
187,000.00 UNIT STAT TR NOTEBD 3.25 22-27 30-06S	180,206.65	1.08	297,000.00 UNITED STATES 2.375 19-29 15/05S	268,715.38	1.60
139,200.00 UNITED STATES 20-27 30/04S	118,428.76	0.71	249,400.00 UNITED STATES 2.375 17-27 15/05S	231,182.10	1.38
194,000.00 UNITED STATES 2.75 22-27 30/04S	183,102.65	1.09	127,300.00 UNITED STATES 2.375 19-26 30/04S	119,701.78	0.71
240,800.00 UNITED STATES 0.75 21-26 31/08S	211,245.56	1.26	43,700.00 UNITED STATES 2.375 19-49 15/11S	47,533.99	0.28
240,800.00 UNITED STATES 1.125 21-26 31/10S	213,503.06	1.27	127,300.00 UNITED STATES 2.625 18-25 31/12S	121,133.91	0.72
245,100.00 UNITED STATES 1.125 21-28 31/08S	207,549.92	1.24	296,900.00 UNITED STATES 2.625 19-29 15/02S	273,565.53	1.62
246,100.00 UNITED STATES 1.375 21-28 31/10S	210,857.72	1.26	123,100.00 UNITED STATES 2.75 18-25 31/08S	118,050.98	0.70
259,300.00 UNITED STATES 2.75 18-28 15/02S	242,870.91	1.45	122,300.00 UNITED STATES 2.875 18-25 30/11S	122,168.22	0.73
127,300.00 UNITED STATES OF AMER 1.625 19-26 30/09S	115,614.25	0.69	123,100.00 UNITED STATES 3.00 18-25 30/09S	118,801.11	0.71
208,500.00 UNITED STATES TR NOTE 1.875 22-27 28/02S	189,963.06	1.13	123,100.00 UNITED STATES 3.00 18-25 31/10S	118,704.95	0.71
245,100.00 UNITED STATES TREA 1.25 21-28 30/09S	208,717.97	1.25	296,900.00 UNITED STATES 3.1250 18-28 15/11S	282,101.41	1.67
246,100.00 UNITED STATES TREASURY NO 1 21-28 31/07S	207,339.25	1.24	44,000.00 UNITED STATES 5.25 98-28 15/11S	46,777.50	0.28
217,100.00 UNITED STATES 0.25 20-25 31/10S	192,218.29	1.15	45,400.00 UNITED STATES 5.25 99-29 15/02S	48,468.04	0.29
210,500.00 UNITED STATES 0.25 20-25 30/09S	187,048.99	1.12	52,300.00 UNITED STATES 6.00 96-26 15/02S	55,147.90	0.33
201,900.00 UNITED STATES 0.25 20-25 31/08S	179,832.96	1.07	44,000.00 UNITED STATES 6.125 99-29 15/08S	49,616.87	0.30
224,600.00 UNITED STATES 0.375 20-25 30/11S	199,121.93	1.19	37,300.00 UNITED STATES 6.375 97-27 15/08S	40,977.55	0.24
233,200.00 UNITED STATES 0.375 20-25 31/12S	206,218.04	1.23	27,000.00 UNITED STATES 6.75 96-26 15/08S	29,486.96	0.18
238,800.00 UNITED STATES 0.375 21-26 31/01S	210,311.90	1.26	127,300.00 US T NOTES 2.625 19-26 31/01S	120,964.84	0.72
198,600.00 UNITED STATES 0.3750 20-27 30/09S	165,629.30	0.99	127,300.00 US TN 2.50 19-26 28/02S	120,348.23	0.72
174,900.00 UNITED STATES 0.3750 20-27 31/07S	146,847.69	0.88	127,300.00 US TREAS N/B 2.125 19-26 31/05S	118,408.90	0.71
151,100.00 UNITED STATES 0.5 20-27 31/05S	128,210.71	0.77	234,200.00 US TREASURY 0.625 20-27 31/12S	196,490.14	1.17
186,700.00 UNITED STATES 0.5 20-27 31/08S	157,250.99	0.94	190,000.00 US TREASURY 2.6250 22-27 31/05S	178,421.88	1.06
163,000.00 UNITED STATES 0.5 20-27 30/06S	138,040.63	0.82	167,000.00 US TREASURY 2.7500 22-29 31/05S	154,631.56	0.92
210,500.00 UNITED STATES 0.50 20-27 31/10S	176,227.97	1.05	240,800.00 US TREASURY N/B 0.8750 21-26 30/09S	211,922.81	1.26
240,800.00 UNITED STATES 0.50 21-26 28/02S	212,524.81	1.27	234,200.00 US TREASURY N/B 1.2500 21-26 30/11S	208,401.41	1.24
222,400.00 UNITED STATES 0.625 20-27 30/11S	186,955.00	1.12	225,600.00 US TREASURY N/B 1.2500 21-26 31/12S	200,378.62	1.20
127,300.00 UNITED STATES 0.625 20-27 31/03B	109,229.37	0.65	220,400.00 US TREASURY N/B 1.3750 21-28 31/12S	188,665.84	1.13
240,800.00 UNITED STATES 0.625 21-26 31/07S	210,681.19	1.26	233,200.00 US TREASURY N/B 1.5000 21-28 30/11S	201,025.70	1.20
245,100.00 UNITED STATES 0.75 21-28 31/01S	206,401.02	1.23	210,400.00 US TREASURY N/B 1.7500 22-29 31/01S	183,754.82	1.10
240,800.00 UNITED STATES 0.75 21-26 30/04S	213,314.94	1.27	198,600.00 US TREASURY N/B 1.8750 22-29 28/02S	174,814.55	1.04
240,800.00 UNITED STATES 0.75 21-26 31/05S	212,769.38	1.27	200,900.00 US TREASURY N/B 2.5000 22-27 31/03S	187,715.94	1.12
240,800.00 UNITED STATES 0.7500 21-26 31/03S	213,879.31	1.28	182,000.00 US TREASURY N/B 2.7500 22-27 31/07S	171,392.82	1.02
240,800.00 UNITED STATES 0.8750 21-26 30/06S	213,220.89	1.27	273,200.00 US TREASURY N/B 2.8750 18-28 15/05S	256,850.70	1.53
127,300.00 UNITED STATES 1.125 20-27 28/02S	112,093.62	0.67	285,000.00 US TREASURY N/B 2.8750 18-28 15/08S	267,365.63	1.60
245,100.00 UNITED STATES 1.125 21-28 29/02S	210,403.03	1.26	174,000.00 US TREASURY N/B 2.8750 22-29 30/04S	162,404.53	0.97
246,100.00 UNITED STATES 1.25 21-28 30/06S	210,953.85	1.26	159,000.00 US TREASURY N/B 3.2500 22-29 30/06S	151,944.38	0.91
246,100.00 UNITED STATES 1.25 21-28 31/05S	211,396.06	1.26	186,000.00 USA 2.375 22-29 31/03S	168,402.65	1.01
245,100.00 UNITED STATES 1.250 21-28 30/04S	210,939.18	1.26	249,400.00 USA T NOTES B 2.25 17-27 15/02S	230,539.12	1.38
245,100.00 UNITED STATES 1.250 21-28 31/03S	211,398.75	1.26	38,300.00 USA TREASURY BOND 6.625 97-27 15/02S	42,043.23	0.25
297,000.00 UNITED STATES 1.375 19-22 15/10S	256,116.11	1.53	88,500.00 USA TREASURY BONDS 6.125 97-27 15/11S	96,624.03	0.58
127,300.00 UNITED STATES 1.375 19-26 31/08S	114,599.84	0.68	47,800.00 USA TREASURY NOTES 5.50 98-28 15/08S	51,328.98	0.31
249,400.00 UNITED STATES 1.50 16-26 15/08S	225,609.58	1.35	Valeurs mobilières négociées sur un autre marché	138,731.25	0.83
218,100.00 UNITED STATES 1.50 20-27 31/01S	195,540.28	1.17	réglementé		
249,400.00 UNITED STATES 1.625 16-26 15/02S	229,077.78	1.37	Obligations	138,731.25	0.83
249,400.00 UNITED STATES 1.625 16-26 15/05S	227,986.67	1.36	Etats-Unis d'Amérique	138,731.25	0.83
127,300.00 UNITED STATES 1.625 19-26 30/11S	115,166.72	0.69	151,000.00 UNITED STATES TREASUR 2.625 22-29 31/07S	138,731.25	0.83
127,300.00 UNITED STATES 1.625 19-26 31/10S	115,335.79	0.69	Total portefeuille-titres	16,651,207.04	99.39
127,300.00 UNITED STATES 1.75 19-26 31/12S	115,644.09	0.69			
127,300.00 UNITED STATES 1.875 19-26 30/06S	117,255.24	0.70			
128,300.00 UNITED STATES 1.875 19-26 31/07S	117,965.83	0.70			
249,400.00 UNITED STATES 2.00 16-26 15/11S	229,038.83	1.37			

Quantité		Valeur d'évaluation	% actifs nets
		USD	
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs		554,686,659.34	101.19
Obligations		554,686,659.34	101.19
Etats-Unis d'Amérique		554,686,659.34	101.19
59,163,400.00	UNITED STATES OF AMER 0.625 20-30 15/08S	46,332,337.62	8.45
55,877,000.00	UNITED STATES TREASUR 2.875 22-32 15/05S	51,620,742.75	9.42
49,434,800.00	UNITED STATES 0.625 20-30 15/05S	38,926,044.14	7.10
64,272,200.00	UNITED STATES 1.125 21-31 15/02S	52,020,311.88	9.49
43,397,600.00	UNITED STATES 1.2500 21-31 15/08S	35,046,951.35	6.39
41,747,300.00	UNITED STATES 1.5000 20-30 15/02S	35,426,499.95	6.46
64,704,700.00	UNITED STATES 1.625 21-31 15/05S	54,276,120.55	9.90
41,199,900.00	UNITED STATES 1.75 19-29 15/11S	35,782,755.87	6.53
64,092,700.00	UNITED STATES -30 15/11U	51,033,812.38	9.31
9,026,800.00	UNITED STATES 5.375 01-31 15/02S	9,977,434.88	1.82
9,363,200.00	UNITED STATES 6.25 99-30 15/05S	10,783,772.53	1.97
60,971,600.00	US TREASURY N/B 1.3750 21-31 15/11S	49,510,847.61	9.03
57,677,400.00	US TREASURY N/B 1.8750 22-32 15/02S	48,841,043.53	8.91
19,175,000.00	US TREASURY N/B 2.7500 22-32 15/08S	17,527,148.44	3.20
18,529,000.00	US TREASURY N/B 3.1250 22-29 31/08S	17,580,835.86	3.21
Total portefeuille-titres		554,686,659.34	101.19

	Note	AMUNDI CAC 40 ESG	AMUNDI EURO STOXX 50	AMUNDI JAPAN TOPIX	AMUNDI JPX- NIKKEI 400
Français		30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR
Actifs		789,509,354.28	1,681,522,916.02	932,343,679.63	251,958,419.35
Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation	2	787,819,869.37	1,677,658,748.48	899,681,993.69	236,500,356.34
<i>Prix d'acquisition</i>		715,206,269.93	1,683,124,413.35	931,284,353.67	257,357,413.62
<i>Plus/moins-value non réalisée sur le portefeuille-titres</i>		72,613,599.44	-5,465,664.87	-31,602,359.98	-20,857,057.28
Avoirs en banque et liquidités		589,436.44	1,686,220.33	17,135.04	6,933.14
A recevoir sur prêt de titres		5,724.94	100,746.20	-	-
Intérêts à recevoir sur prises en pension livrées		-	-	11,128,989.43	2,766,681.93
Autres intérêts à recevoir		-	-	-	-
Dividendes à recevoir	2	12,067.48	1,358,401.03	340,312.14	10,631.52
Frais de constitution		-	-	-	-
Brokers à recevoir		-	-	19,076,576.52	12,182,786.10
Souscriptions à recevoir		1,082,256.05	-	-	-
Plus-value nette non réalisée sur contrats de change à terme	2,10	-	-	-	-
Plus-value nette non réalisée sur "futures"	2,11	-	-	-	-
Plus-value nette non réalisée sur swaps	2,5	-	-	2,098,672.81	491,030.32
A recevoir sur change spot		-	-	-	-
Autres actifs		-	718,799.98	-	-
Passifs		1,818,627.58	1,203,339.00	34,548,308.93	15,057,130.12
Dettes bancaires à vue		-	-	1,576.50	-
Brokers à payer		-	-	33,399,272.43	14,715,590.76
Rachats à payer		1,082,260.19	-	-	-
Moins-value nette non réalisée sur contrats de change à terme	2,10	-	-	-	-
Moins-value nette non réalisée sur "futures"	2,11	30,525.00	148,150.00	-	-
Moins-value nette non réalisée sur swaps	2,5	-	-	-	-
Frais de gestion à payer	4	279,715.19	123,030.20	559,557.55	43,124.66
Frais d'administratifs	4	223,772.16	492,120.70	247,590.31	53,905.91
A payer sur prêt de titres		2,004.38	35,261.26	-	-
A payer sur change spot		-	-	-	-
A payer sur swap		-	-	340,312.14	244,508.79
Autres passifs		200,350.66	404,776.84	-	-
Valeur nette d'inventaire		787,690,726.70	1,680,319,577.02	897,795,370.70	236,901,289.23

AMUNDI MSCI BRAZIL	AMUNDI MSCI CHINA	AMUNDI MSCI EASTERN EUROPE EX RUSSIA	AMUNDI MSCI EM ASIA	AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA	AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS	AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND	AMUNDI MSCI INDIA
30/09/22 USD	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR
6,999,369.70	80,408,113.56	19,126,694.13	2,017,859,673.56	276,528,181.32	3,164,113,908.17	222,971,444.19	146,609,807.46
6,707,862.17	74,787,067.82	16,811,118.73	1,817,658,171.60	263,673,943.94	2,755,464,892.03	197,279,962.89	139,006,097.73
7,735,482.03	82,589,424.81	17,021,858.62	1,906,931,799.89	287,224,597.05	2,983,713,079.76	202,532,061.82	151,481,288.31
-1,027,619.86	-7,802,356.99	-210,739.89	-89,273,628.29	-23,550,653.11	-228,248,187.73	-5,252,098.93	-12,475,190.58
1,222.27	4,520.60	1,479.50	63,395.23	10,672.58	111,943.95	6,148.40	2,232.00
-	-	-	-	-	-	-	-
56,311.11	4,471.91	1,733.62	833,231.25	2,869,517.52	12,455,833.97	3,652,103.08	1,629,534.56
-	-	-	-	-	-	-	-
6,779.19	36,646.59	13,033.41	587,418.56	68,477.67	1,148,385.63	22,848.66	89,649.63
-	-	-	-	-	-	-	-
175,438.75	5,211,978.18	2,299,328.87	167,791,203.68	6,675,464.47	318,620,461.75	18,415,997.69	3,525,911.11
-	-	-	-	-	37,032,420.00	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
51,756.21	363,428.46	-	30,926,253.24	3,230,105.14	39,279,970.84	3,594,383.47	2,356,382.43
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
247,874.28	5,369,655.57	2,336,457.29	170,282,349.05	9,752,339.07	375,314,463.19	22,198,746.90	5,535,732.95
-	-	462.67	265.98	328.73	973.03	-	-
114,950.52	4,254,520.84	1,827,120.18	150,307,295.87	7,479,900.67	335,581,647.33	22,054,007.24	4,209,784.01
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	9,301.45	-	-	-	-	-
7,646.11	95,366.33	6,298.64	535,114.80	69,275.34	753,313.62	53,898.74	254,307.96
1,699.11	21,192.56	6,298.64	535,114.80	69,275.34	753,313.62	53,898.74	36,329.69
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
123,578.54	998,575.84	486,975.71	18,904,557.60	2,133,558.99	38,225,215.59	36,942.18	1,035,311.29
-	-	-	-	-	-	-	-
6,751,495.42	75,038,457.99	16,790,236.84	1,847,577,324.51	266,775,842.25	2,788,799,444.98	200,772,697.29	141,074,074.51

	Note	AMUNDI MSCI NORDIC	AMUNDI MSCI SWITZERLAND	AMUNDI MSCI USA	AMUNDI MSCI WORLD
Français		30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR
Actifs		192,511,698.00	682,047,607.61	828,881,576.70	2,262,294,976.78
Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation	2	173,179,321.02	595,652,515.21	776,248,294.13	2,052,720,248.53
<i>Prix d'acquisition</i>		173,966,286.06	620,138,922.64	712,231,504.71	2,186,203,210.02
<i>Plus/moins-value non réalisée sur le portefeuille-titres</i>		-786,965.04	-24,486,407.43	64,016,789.42	-133,482,961.49
Avoirs en banque et liquidités		3,677.54	11,448.55	38,673.34	111,619.10
A recevoir sur prêt de titres		-	-	-	-
Intérêts à recevoir sur prises en pension livrées		3,947,627.09	43,967,771.75	3,244,701.13	34,393,673.82
Autres intérêts à recevoir		-	-	-	-
Dividendes à recevoir	2	122,154.84	170,532.81	535,179.87	798,149.21
Frais de constitution		-	-	-	-
Brokers à recevoir		12,880,690.38	38,755,585.28	48,814,728.23	174,271,286.12
Souscriptions à recevoir		-	-	-	-
Plus-value nette non réalisée sur contrats de change à terme	2,10	-	-	-	-
Plus-value nette non réalisée sur "futures"	2,11	-	-	-	-
Plus-value nette non réalisée sur swaps	2,5	2,378,227.13	3,489,754.01	-	-
A recevoir sur change spot		-	-	-	-
Autres actifs		-	-	-	-
Passifs		17,072,352.52	83,290,496.30	67,527,372.06	240,393,415.94
Dettes bancaires à vue		-	-	-	3,100.27
Brokers à payer		13,962,140.94	73,912,052.31	36,679,755.07	166,145,545.69
Rachats à payer		-	-	3,230,512.40	-
Moins-value nette non réalisée sur contrats de change à terme	2,10	-	-	-	-
Moins-value nette non réalisée sur "futures"	2,11	-	-	-	-
Moins-value nette non réalisée sur swaps	2,5	-	-	14,311,753.92	28,835,777.92
Frais de gestion à payer	4	73,128.12	237,963.86	399,220.04	1,541,052.59
Frais d'administratifs	4	48,752.09	158,642.60	221,788.88	550,375.99
A payer sur prêt de titres		-	-	-	-
A payer sur change spot		-	-	-	-
A payer sur swap		2,988,331.37	8,981,837.53	12,684,341.75	43,317,563.48
Autres passifs		-	-	-	-
Valeur nette d'inventaire		175,439,345.48	598,757,111.31	761,354,204.64	2,021,901,560.84

AMUNDI MSCI WORLD ENERGY	AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE	AMUNDI MSCI WORLD FINANCIALS	AMUNDI RUSSELL 2000	AMUNDI S&P 500	AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY	AMUNDI SMART CITY	AMUNDI SMART FACTORY
30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR
97,470,655.41	574,932,459.19	129,208,566.40	149,527,969.43	7,107,504,955.61	341,270,140.37	15,597,791.00	29,665,381.94
90,267,154.71	455,602,712.99	125,497,127.01	143,299,980.21	6,379,914,970.95	323,002,791.41	14,042,575.93	28,565,352.78
100,274,074.64	478,167,192.56	135,998,462.73	149,796,869.86	6,671,320,493.18	341,320,572.10	15,678,416.40	29,702,905.08
-10,006,919.93	-22,564,479.57	-10,501,335.72	-6,496,889.65	-291,405,522.23	-18,317,780.69	-1,635,840.47	-1,137,552.30
2,846.08	9,736.86	1,491.17	5,884.08	145,549.11	12,712.93	12,425.77	687.65
-	-	-	-	-	-	-	-
3,235,580.39	42,856,059.80	753,444.42	2,407,978.83	25,933,640.06	-	63,275.27	512,368.92
-	-	-	-	-	-	-	-
20,717.25	35,129.97	25,990.23	19,364.16	1,212,341.13	6,824.79	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
3,302,522.82	76,428,819.57	2,511,059.41	3,794,762.15	700,298,454.36	13,490,614.95	1,418,822.52	586,972.59
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
641,834.16	-	419,454.16	-	-	4,757,196.29	60,691.51	-
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
6,647,384.45	172,577,877.36	3,412,227.43	8,363,239.03	775,253,007.21	13,718,431.59	1,508,586.79	1,134,166.75
-	-	-	135.10	-	-	-	12.22
6,521,228.35	89,412,596.87	3,264,503.83	4,208,801.53	702,426,971.75	8,370,837.36	1,443,468.44	1,096,899.07
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
-	48,347,199.12	-	2,003,502.68	62,596,119.57	-	-	7,313.90
63,260.01	273,687.45	86,952.44	98,211.47	1,170,508.71	132,595.11	10,149.21	19,642.23
25,303.98	109,474.98	34,780.93	39,284.64	1,763,694.20	88,396.73	4,059.68	7,856.89
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
37,592.11	34,434,918.94	25,990.23	2,013,303.61	7,295,712.98	5,126,602.39	50,909.46	2,442.44
-	-	-	-	-	-	-	-
90,823,270.96	402,354,581.83	125,796,338.97	141,164,730.40	6,332,251,948.40	327,551,708.78	14,089,204.21	28,531,215.19

	Note	AMUNDI STOXX GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE	AMUNDI DAX 50 ESG	AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG	AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB
Français		30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR
Actifs		346,517,005.74	12,483,822.26	145,819,824.17	1,709,446,034.32
Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation	2	335,170,666.31	12,442,782.01	144,727,171.07	1,695,021,277.63
<i>Prix d'acquisition</i>		<i>349,208,242.03</i>	<i>16,011,192.08</i>	<i>167,407,452.54</i>	<i>1,995,724,094.64</i>
<i>Plus/moins-value non réalisée sur le portefeuille-titres</i>		<i>-14,037,575.72</i>	<i>-3,568,410.07</i>	<i>-22,680,281.47</i>	<i>-300,702,817.01</i>
Avoirs en banque et liquidités		3,140.71	40,223.56	945,710.05	12,397,930.07
A recevoir sur prêt de titres		-	816.69	12,956.14	125,012.11
Intérêts à recevoir sur prises en pension livrées		2,069,169.45	-	-	-
Autres intérêts à recevoir		-	-	-	-
Dividendes à recevoir	2	-	-	133,986.91	1,899,516.23
Frais de constitution		-	-	-	-
Brokers à recevoir		8,980,486.67	-	-	-
Souscriptions à recevoir		-	-	-	-
Plus-value nette non réalisée sur contrats de change à terme	2,10	-	-	-	-
Plus-value nette non réalisée sur "futures"	2,11	-	-	-	-
Plus-value nette non réalisée sur swaps	2,5	293,542.60	-	-	-
A recevoir sur change spot		-	-	-	2,298.28
Autres actifs		-	-	-	-
Passifs		11,373,452.35	10,344.93	171,945.38	8,099,645.31
Dettes bancaires à vue		538.14	-	201.70	-
Brokers à payer		10,888,100.70	-	-	-
Rachats à payer		-	-	-	6,287,891.29
Moins-value nette non réalisée sur contrats de change à terme	2,10	-	-	-	-
Moins-value nette non réalisée sur "futures"	2,11	-	3,538.50	85,210.00	303,472.23
Moins-value nette non réalisée sur swaps	2,5	-	-	-	-
Frais de gestion à payer	4	230,898.65	829.43	21,649.84	797,362.77
Frais d'administratifs	4	92,359.43	3,317.81	39,363.34	383,383.92
A payer sur prêt de titres		-	286.01	4,534.61	43,754.28
A payer sur change spot		-	-	-	-
A payer sur swap		161,555.43	-	-	-
Autres passifs		-	2,373.18	20,985.89	283,780.82
Valeur nette d'inventaire		335,143,553.39	12,473,477.33	145,647,878.79	1,701,346,389.01

AMUNDI BBB EURO CORPORATE INVESTMENT GRADE ESG	AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE ESG	AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX	AMUNDI GOVT BOND EURO BROAD INVESTMENT GRADE	AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE	AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE 1-3	AMUNDI US TREASURY 1-3	AMUNDI US TREASURY 3-7
30/09/22 EUR	30/09/22 USD	30/09/22 USD	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 USD	30/09/22 USD
51,090,420.27	1,568,046,420.74	146,446,385.77	305,663,111.75	467,875,851.09	111,650,240.16	59,642,271.89	16,760,468.11
49,468,698.59	1,484,273,014.99	143,609,035.18	302,063,689.87	448,992,421.52	110,180,879.32	59,296,476.17	16,651,207.04
54,956,411.77	1,502,409,176.49	173,449,026.60	362,739,182.95	548,049,845.08	116,621,405.79	61,474,208.67	18,145,433.24
-5,487,713.18	-18,136,161.50	-29,839,991.42	-60,675,493.08	-99,057,423.56	-6,440,526.47	-2,177,732.50	-1,494,226.20
1,197,709.44	78,409,412.38	663,754.17	993,803.68	146,511.68	146,546.29	116,769.88	37,377.68
-	-	12,861.06	25,018.80	6,768.29	2,155.35	2,226.43	374.16
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
424,012.24	5,363,993.37	2,160,735.36	2,580,599.40	4,438,967.84	1,320,659.20	226,799.41	71,509.23
-	-	-	-	14,291,181.76	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
47,262.22	58,067,915.73	147,082.21	219,117.59	14,649,985.72	56,707.63	24,457.69	7,178.90
-	474.52	-	-	-	-	-	-
-	37,074,642.30	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	14,348,695.00	-	-	-
-	20,031,230.81	-	-	-	-	-	-
11,810.00	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
14,121.77	374,771.23	81,888.07	38,458.43	59,752.25	12,493.22	6,032.55	1,775.66
9,414.54	274,094.79	28,104.56	59,824.21	92,947.98	19,433.87	9,383.98	2,762.18
-	-	4,501.37	15,696.30	2,368.87	754.38	869.50	131.82
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
11,915.91	312,702.08	32,588.21	105,138.65	146,221.62	24,026.16	8,171.66	2,509.24
51,043,158.05	1,509,978,505.01	146,299,303.56	305,443,994.16	453,225,865.37	111,593,532.53	59,617,814.20	16,753,289.21

Français	Note	AMUNDI US	Consolidé
		TREASURY 7-10	
		30/09/22	30/09/22
		USD	EUR
Actifs		575,221,610.95	90,576,562,509.82
Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation	2	554,686,659.34	87,043,001,034.99
<i>Prix d'acquisition</i>		<i>610,295,808.59</i>	<i>95,999,961,237.96</i>
<i>Plus/moins-value non réalisée sur le portefeuille-titres</i>		<i>-55,609,149.25</i>	<i>-8,956,960,202.97</i>
Avoirs en banque et liquidités		17,732,578.84	928,699,672.81
A recevoir sur prêt de titres		67,837.19	2,487,618.70
Intérêts à recevoir sur prises en pension livrées		-	225,289,578.09
Autres intérêts à recevoir		-	43,643.87
Dividendes à recevoir	2	-	74,690,822.00
Frais de constitution		2,734,535.58	139,994,141.30
Brokers à recevoir		-	1,836,680,128.78
Souscriptions à recevoir		-	159,605,625.84
Plus-value nette non réalisée sur contrats de change à terme	2,10	-	26,565,767.85
Plus-value nette non réalisée sur "futures"	2,11	-	6,387,903.24
Plus-value nette non réalisée sur swaps	2,5	-	129,937,614.65
A recevoir sur change spot		-	84,243.53
Autres actifs		-	3,094,714.17
Passifs		27,043,522.96	3,080,320,904.38
Dettes bancaires à vue		16,390,618.72	154,202,026.11
Brokers à payer		-	2,300,048,004.07
Rachats à payer		-	109,790,771.65
Moins-value nette non réalisée sur contrats de change à terme	2,10	10,379,331.59	91,826,198.82
Moins-value nette non réalisée sur "futures"	2,11	-	19,340,655.56
Moins-value nette non réalisée sur swaps	2,5	-	169,401,777.99
Frais de gestion à payer	4	63,486.37	19,227,950.15
Frais d'administratifs	4	98,756.60	20,728,035.65
A payer sur prêt de titres		26,419.45	865,785.65
A payer sur change spot		-	240,040.84
A payer sur swap		-	180,834,629.06
Autres passifs		84,910.23	13,815,028.83
Valeur nette d'inventaire		548,178,087.99	87,496,241,605.44

AMUNDI CAC 40

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action	VNI par action	VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020
Classe UCITS ETF DR EUR de capitalisation	LU1681046931	6.992.726,00		EUR	89,47	100,08	72,17
Classe UCITS ETF DR EUR de distribution	LU1681047079	2.791.234,00		EUR	58,06	66,22	48,62
Actifs Nets Totaux				EUR	787.690.726,70	1.231.032.426,47	1.013.196.756,04

AMUNDI EURO STOXX 50

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action	VNI par action	VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020
Classe UCITS ETF DR EUR de capitalisation	LU1681047236	19.787.117,28		EUR	79,52	94,15	72,62
Classe UCITS ETF DR EUR de distribution	LU1681047319	1.808.981,00		EUR	53,44	64,41	50,73
Classe UCITS ETF DR USD de capitalisation	LU1681047400	126.954,00		USD	77,91	109,11	85,16
Actifs Nets Totaux				EUR	1.680.319.577,02	2.303.924.325,59	2.271.536.700,49

AMUNDI JAPAN TOPIX

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action	VNI par action	VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020
Classe UCITS ETF DAILY HEDGED CHF de capitalisation	LU1681038169	42.777,00		CHF	66,49	73,02	58,35
Classe UCITS ETF DAILY HEDGED EUR de capitalisation	LU1681037864	1.593.625,00		EUR	245,18	269,45	215,17
Classe UCITS ETF DAILY HEDGED GBP de capitalisation	LU1681038086	88.602,00		GBP	69,77	75,80	60,18
Classe UCITS ETF DAILY HEDGED USD de capitalisation	LU1681037948	320.478,00		USD	76,12	81,96	64,83
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681037609	4.185.319,00		EUR	81,23	96,42	79,48
Classe UCITS ETF JPY de capitalisation	LU1681037781	1.627.499,00		JPY	11.519,00	12.469,00	9.836,00
Actifs Nets Totaux				EUR	897.795.370,70	1.057.187.669,44	749.875.983,87

AMUNDI JPX-NIKKEI 400

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action	VNI par action	VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020
Classe UCITS ETF DAILY HEDGED CHF de capitalisation	LU1681047665	76.900,00		CHF	86,73	95,39	75,81
Classe UCITS ETF DAILY HEDGED EUR de capitalisation	LU1681039134	632.362,00		EUR	178,34	196,32	155,94
Classe UCITS ETF DAILY HEDGED GBP de capitalisation	LU1681039308	6.348,00		GBP	187,49	204,07	161,18
Classe UCITS ETF DAILY HEDGED USD de capitalisation	LU1681039217	166.549,00		USD	199,13	214,72	168,90
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681038912	379.702,00		EUR	136,23	162,49	133,56
Classe UCITS ETF JPY de capitalisation	LU1681039050	222.235,00		JPY	19.315,00	21.009,00	16.527,00
Actifs Nets Totaux				EUR	236.901.289,23	276.134.881,26	199.477.463,33

AMUNDI MSCI BRAZIL

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action	VNI par action	VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020
Classe UCITS ETF de capitalisation	LU1437024992	158.247,00		USD	42,66	41,15	34,26
Actifs Nets Totaux				USD	6.751.495,42	6.511.746,05	9.053.475,28

AMUNDI MSCI CHINA

	Isin	Nombre d'actions		VNI par action		VNI par action	
		30/09/2022	Currency	30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020	30/09/2020
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681043912	289.376,00	EUR	244,39	261,71	221,26	
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681044050	17.671,00	USD	239,41	303,31	259,45	
Actifs Nets Totaux			EUR	75.038.457,99	73.425.720,31	63.190.661,64	

AMUNDI MSCI EASTERN EUROPE EX RUSSIA

	Isin	Nombre d'actions		VNI par action		VNI par action	
		30/09/2022	Currency	30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020	30/09/2020
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681043755	73.150,00	EUR	180,93	294,89	204,49	
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681043839	19.648,00	USD	177,25	341,76	239,80	
Actifs Nets Totaux			EUR	16.790.236,84	31.829.522,24	22.146.539,79	

AMUNDI MSCI EM ASIA

	Isin	Nombre d'actions		VNI par action		VNI par action	
		30/09/2022	Currency	30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020	30/09/2020
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681044480	36.568.364,00	EUR	30,72	36,91	32,14	
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681044563	23.566.615,00	USD	30,10	42,78	37,68	
Actifs Nets Totaux			EUR	1.847.577.324,51	2.485.312.626,57	2.152.610.809,49	

AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA

	Isin	Nombre d'actions		VNI par action		VNI par action	
		30/09/2022	Currency	30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020	30/09/2020
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681045024	15.932.765,00	EUR	13,61	11,50	8,98	
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681045297	3.674.034,00	USD	13,33	13,33	10,54	
Actifs Nets Totaux			EUR	266.775.842,25	215.886.036,47	124.308.540,73	

AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS

	Isin	Nombre d'actions		VNI par action		VNI par action	
		30/09/2022	Currency	30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020	30/09/2020
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681045370	455.268.077,00	EUR	4,26	5,01	4,20	
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681045453	200.035.347,00	USD	4,17	5,81	4,93	
Actifs Nets Totaux			EUR	2.788.799.444,98	3.819.762.571,75	3.607.787.066,43	

AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND

	Isin	Nombre d'actions		VNI par action		VNI par action	
		30/09/2022	Currency	30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020	30/09/2020
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681044308	885.936,00	EUR	226,62	259,42	197,44	
Actifs Nets Totaux			EUR	200.772.697,29	165.737.533,33	29.417.621,14	

AMUNDI MSCI INDIA

	Isin	Nombre d'actions		VNI par action		VNI par action	
		30/09/2022	Currency	30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020	30/09/2020
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681043086	135.841,00	EUR	777,54	740,13	485,39	
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681043169	45.595,00	USD	761,72	857,77	569,20	
Actifs Nets Totaux			EUR	141.074.074,51	182.212.873,23	106.096.504,87	

AMUNDI MSCI NORDIC

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action		VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681044647	370.093,00		EUR	474,04	565,37	431,81
Actifs Nets Totaux				EUR	175.439.345,48	289.428.561,53	184.477.935,08

AMUNDI MSCI SWITZERLAND

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action		VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	
Classe UCITS ETF CHF de capitalisation	LU1681044993	48.074.280,00		CHF	8,99	408,90	352,69
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681044720	16.159.040,00		EUR	9,32	378,23	327,36
Actifs Nets Totaux				EUR	598.757.111,31	234.021.544,49	268.607.327,38

AMUNDI MSCI USA

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action		VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681042864	1.012.467,00		EUR	464,68	476,32	361,96
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681042948	625.977,00		USD	455,23	552,03	424,46
Actifs Nets Totaux				EUR	761.354.204,64	1.268.661.605,64	1.273.594.972,19

AMUNDI MSCI WORLD

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action		VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681043599	5.347.337,00		EUR	374,15	393,88	302,44
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681043672	56.595,00		USD	366,54	456,49	354,66
Actifs Nets Totaux				EUR	2.021.901.560,84	1.777.790.336,05	1.153.138.509,67

AMUNDI MSCI WORLD ENERGY

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action		VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681046006	218.394,00		EUR	362,24	240,80	140,87
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681046188	32.333,00		USD	354,87	279,08	165,19
Actifs Nets Totaux				EUR	90.823.270,96	93.429.676,71	37.783.027,39

AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action		VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681045537	964.930,00		EUR	415,80	432,02	331,25
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681045610	2.735,00		USD	407,34	500,69	388,44
Actifs Nets Totaux				EUR	402.354.581,83	392.095.933,63	279.779.449,05

AMUNDI MSCI WORLD FINANCIALS

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action		VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681045883	553.225,00		EUR	196,57	206,97	133,89
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681045966	86.718,00		USD	192,57	239,87	157,00
Actifs Nets Totaux				EUR	125.796.338,97	182.337.732,87	47.231.199,27

AMUNDI RUSSELL 2000

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action	VNI par action	VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681038672	410.216,00		EUR	245,57	272,52	183,15
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681038839	164.622,00		USD	240,58	315,84	214,77
Actifs Nets Totaux				EUR	141.164.730,40	189.714.234,22	84.761.495,52

AMUNDI S&P 500

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action	VNI par action	VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020
Classe UCITS ETF DAILY HEDGED EUR de capitalisation	LU1681049109	8.401.998,00		EUR	88,93	108,13	84,19
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681048804	33.136.353,00		EUR	69,73	69,84	53,11
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681049018	46.942.314,00		USD	68,31	80,94	62,28
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU2391437253	23.030,00		USD	38,81	-	-
Actifs Nets Totaux				EUR	6.332.251.948,40	6.534.539.403,97	5.661.393.348,32

AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action	VNI par action	VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681048630	1.684.171,00		EUR	174,23	195,31	138,68
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681048713	195.809,00		USD	170,69	226,36	162,62
Actifs Nets Totaux				EUR	327.551.708,78	276.232.649,07	95.148.225,58

AMUNDI SMART CITY

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action	VNI par action	VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU2037748345	275.037,00		EUR	51,23	62,58	52,26
Actifs Nets Totaux				EUR	14.089.204,21	75.759.465,73	64.796.254,91

AMUNDI SMART FACTORY

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action	VNI par action	VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU2037749822	484.548,00		EUR	58,88	78,40	61,54
Actifs Nets Totaux				EUR	28.531.215,19	69.927.999,33	58.899.005,39

AMUNDI STOXX GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action	VNI par action	VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020
Classe UCITS ETF de capitalisation	LU1861132840	4.852.396,00		EUR	69,07	81,63	58,21
Actifs Nets Totaux				EUR	335.143.553,39	329.400.687,19	187.716.636,84

AMUNDI DAX 50 ESG

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action	VNI par action	VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020
Classe UCITS ETF DR de capitalisation	LU2240851688	281.550,00		EUR	44,30	57,34	-
Actifs Nets Totaux				EUR	12.473.477,33	6.678.669,47	-

AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action		VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681040223	1.617.978,00		EUR	90,02	103,08	80,13
Actifs Nets Totaux				EUR	145.647.878,79	187.447.360,74	126.749.666,58

AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action		VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	
Classe I14E de capitalisation	LU2469334648	9.537,40		EUR	899,22	-	-
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681042609	7.010.894,00		EUR	241,45	276,59	214,57
Actifs Nets Totaux				EUR	1.701.346.389,01	2.677.983.760,46	2.317.254.355,83

AMUNDI BBB EURO CORPORATE INVESTMENT GRADE ESG

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action		VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681041387	3.747.501,00		EUR	13,62	16,28	16,08
Actifs Nets Totaux				EUR	51.043.158,05	131.398.005,42	357.734.223,64

AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE ESG

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action		VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	
Classe UCITS ETF HEDGED CHF de capitalisation	LU1732799066	-		CHF	-	-	49,36
Classe UCITS ETF HEDGED EUR de capitalisation	LU1681041031	16.892.389,00		EUR	49,17	50,02	50,11
Classe UCITS ETF HEDGED MXN de capitalisation	LU2098887180	49.600,00		MXN	1.155,34	1.085,00	1.032,57
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681040900	6.202.577,00		USD	111,79	111,98	111,20
Actifs Nets Totaux				USD	1.509.978.505,01	1.488.063.778,35	1.526.231.541,26

AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action		VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681041205	1.274.000,00		USD	114,83	145,59	140,29
Actifs Nets Totaux				USD	146.299.303,56	219.191.579,87	195.633.133,59

AMUNDI GOVT BOND EURO BROAD INVESTMENT GRADE

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action		VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681046261	1.481.000,00		EUR	206,24	249,85	254,79
Actifs Nets Totaux				EUR	305.443.994,16	529.672.410,21	595.958.475,18

AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action		VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681046774	1.382.822,00		EUR	210,86	256,64	259,54
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681046857	838.351,00		EUR	192,81	238,12	244,46
Actifs Nets Totaux				EUR	453.225.865,37	1.210.800.842,90	1.204.958.742,93

AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE 1-3

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action	VNI par action	VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020
Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	LU1681046345	1.021.001,00		EUR	109,30	114,72	115,18
Actifs Nets Totaux				EUR	111.593.532,53	150.163.162,14	186.594.684,88

AMUNDI US TREASURY 1-3

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action	VNI par action	VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681040819	346.100,00		USD	172,26	181,19	181,46
Actifs Nets Totaux				USD	59.617.814,20	82.461.753,48	65.780.856,46

AMUNDI US TREASURY 3-7

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action	VNI par action	VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681040736	82.000,00		USD	204,31	229,99	234,35
Actifs Nets Totaux				USD	16.753.289,21	10.004.709,14	16.052.911,33

AMUNDI US TREASURY 7-10

	Isin	Nombre d'actions		Currency	VNI par action	VNI par action	VNI par action
		30/09/2022			30/09/2022	30/09/2021	30/09/2020
Classe UCITS ETF DR - HEDGED EUR de capitalisation	LU2153616169	8.496.531,00		EUR	41,46	49,86	-
Classe UCITS ETF USD de capitalisation	LU1681040652	826.509,00		USD	245,68	290,23	304,79
Actifs Nets Totaux				USD	548.178.087,99	238.238.460,61	784.846.116,92

	Note	AMUNDI CAC 40 ESG	AMUNDI EURO STOXX 50	AMUNDI JAPAN TOPIX	AMUNDI JPX-NIKKEI 400
Français		30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR
Revenus		33,781,376.64	67,993,362.33	8,363,169.48	1,338,286.17
Dividendes nets	2	33,602,028.74	67,378,765.28	8,347,249.65	1,336,655.70
Intérêts sur obligations	2	-	-	-	-
Intérêts bancaires	2	366.28	789.15	4,168.13	17.93
Intérêts sur prises en pension	6	162,619.03	523,122.39	-	-
Intérêts reçus sur swaps		-	-	-	-
Autres revenus		16,362.59	90,685.51	11,751.70	1,612.54
Dépenses		3,799,248.99	4,028,696.12	3,564,402.74	535,461.53
Commissions de gestion	4	1,405,390.70	552,129.13	2,479,292.12	197,749.72
Frais administratifs	4	1,124,312.58	2,208,516.37	1,025,751.47	247,187.39
Frais de transactions	2	1,245,810.85	1,203,384.58	57,533.95	90,233.98
Intérêts bancaires & charges similaires		22,841.13	59,046.32	1,199.19	290.44
Intérêts payés sur swaps		-	-	-	-
Autres dépenses		893.73	5,619.72	626.01	-
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur investissements		29,982,127.65	63,964,666.21	4,798,766.74	802,824.64
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur vente de titres	2	103,964,477.89	63,489,881.92	-33,559,500.42	-18,743,748.34
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur contrats de change à terme	2	-	-	3,570,825.18	467,000.69
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur "futures"	2	-60,424.93	-527,515.49	-	-
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur swaps	2	-	-	-133,411,660.85	-351,431.57
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur change	2	8,205.66	45,796.69	119,046,070.18	23,842,117.37
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e)		133,894,386.27	126,972,829.33	-39,555,499.17	6,016,762.79
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur portefeuille-titres		-230,815,761.93	-454,186,354.43	-87,078,726.11	-34,045,329.85
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur contrats de change à terme		-	-	-	-
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur "futures"		1,970.00	-124,380.00	-	-
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur swaps		-	-	-245,904.09	-94,145.94
Résultat des opérations		-96,919,405.66	-327,337,905.10	-126,880,129.37	-28,122,713.00
Dividendes payés	9	-4,287,525.20	-1,785,819.48	-	-
Souscriptions		138,046,904.97	542,409,629.71	427,516,987.45	90,603,826.16
Rachats		-480,181,673.88	-836,890,653.70	-460,029,156.82	-101,714,705.19
Augmentation/(diminution) des actifs nets		-443,341,699.77	-623,604,748.57	-159,392,298.74	-39,233,592.03
Réévaluation de la balance d'ouverture		-	-	-	-
Actifs nets au début de l'année		1,231,032,426.47	2,303,924,325.59	1,057,187,669.44	276,134,881.26
Actifs nets à la fin de l'année		787,690,726.70	1,680,319,577.02	897,795,370.70	236,901,289.23

AMUNDI MSCI BRAZIL	AMUNDI MSCI CHINA	AMUNDI MSCI EASTERN EUROPE EX RUSSIA	AMUNDI MSCI EM ASIA	AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA	AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS	AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND	AMUNDI MSCI INDIA
30/09/22 USD	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR
110,579.36	1,650,456.91	541,006.93	17,479,918.06	3,008,954.83	27,629,801.06	930,688.27	1,763,270.80
110,252.30	1,646,013.78	539,927.67	17,442,581.08	2,999,256.55	27,599,244.81	924,971.25	1,761,877.11
-	-	-	-	-	-	-	-
65.97	-	4.33	36.17	11.63	60.10	-	7.73
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
261.09	4,443.13	1,074.93	37,300.81	9,686.65	30,496.15	5,717.02	1,385.96
37,387.94	426,081.72	57,415.05	4,860,976.07	496,132.47	6,864,912.77	417,265.06	1,270,929.52
30,535.15	347,999.97	28,624.05	2,350,824.18	242,142.08	3,319,181.58	204,453.19	1,107,566.93
6,785.58	77,333.42	28,624.05	2,350,824.18	242,142.08	3,319,181.58	204,453.19	158,223.91
49.69	747.10	122.38	158,532.11	11,389.36	224,991.26	8,317.06	5,076.94
17.52	1.23	44.57	795.60	124.56	1,558.35	41.62	61.74
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	334.39	-	-	-
73,191.42	1,224,375.19	483,591.88	12,618,941.99	2,512,822.36	20,764,888.29	513,423.21	492,341.28
-387,381.33	-830,342.28	-1,338,627.48	-119,410,193.42	-10,202,574.85	2,066,781.67	-31,756,373.49	-24,375,335.97
-	-	-	-	-	3,734,047.40	-	-
-	-	4,397.03	-	-	-	-	-
2,023,736.37	3,165,910.39	-8,048,781.84	-398,538,807.27	69,816,527.97	-588,041,421.91	5,952,558.49	33,347,703.49
-736,348.14	1,122,576.92	439,564.49	298,451,763.57	20,755,638.82	410,498,893.73	17,740,106.38	11,212,292.50
973,198.32	4,682,520.22	-8,459,855.92	-206,878,295.13	82,882,414.30	-150,976,810.82	-7,550,285.41	20,677,001.30
-827,762.55	-9,737,482.31	-3,370,770.53	-202,592,775.70	-50,371,167.08	-321,879,692.37	-23,538,982.35	-15,706,279.20
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
94,313.60	-965,856.27	-179,684.58	-345,866.98	2,194,461.04	-29,942,920.97	2,511,427.75	894,678.91
239,749.37	-6,020,818.36	-12,010,311.03	-409,816,937.81	34,705,708.26	-502,799,424.16	-28,577,840.01	5,865,401.01
-	-	-	-	-	-	-	-
-	44,130,915.28	21,584,691.36	492,393,387.88	216,881,218.07	281,561,641.68	92,107,047.47	32,599,932.07
-	-36,497,359.24	-24,613,665.73	-720,311,752.13	-200,697,120.55	-809,725,344.29	-28,494,043.50	-79,604,131.80
239,749.37	1,612,737.68	-15,039,285.40	-637,735,302.06	50,889,805.78	-1,030,963,126.77	35,035,163.96	-41,138,798.72
-	-	-	-	-	-	-	-
6,511,746.05	73,425,720.31	31,829,522.24	2,485,312,626.57	215,886,036.47	3,819,762,571.75	165,737,533.33	182,212,873.23
6,751,495.42	75,038,457.99	16,790,236.84	1,847,577,324.51	266,775,842.25	2,788,799,444.98	200,772,697.29	141,074,074.51

	Note	AMUNDI MSCI NORDIC	AMUNDI MSCI SWITZERLAND	AMUNDI MSCI USA	AMUNDI MSCI WORLD
Français		30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR
Revenus		2,097,478.69	2,553,376.82	23,724,998.85	46,100,391.71
Dividendes nets	2	2,096,437.22	2,548,901.90	23,591,785.60	46,023,821.20
Intérêts sur obligations	2	-	-	-	-
Intérêts bancaires	2	-	13.07	634.68	9.27
Intérêts sur prises en pension	6	-	-	-	-
Intérêts reçus sur swaps		-	-	-	-
Autres revenus		1,041.47	4,461.85	132,578.57	76,561.24
Dépenses		580,981.38	1,233,562.62	3,639,643.58	8,233,748.66
Commissions de gestion	4	344,792.70	702,246.84	2,234,794.63	5,874,114.30
Frais administratifs	4	229,861.85	468,164.53	1,241,552.45	2,097,897.93
Frais de transactions	2	6,165.98	63,058.78	161,583.12	257,424.05
Intérêts bancaires & charges similaires		74.49	92.47	1,608.52	1,148.60
Intérêts payés sur swaps		-	-	-	-
Autres dépenses		86.36	-	104.86	3,163.78
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur investissements		1,516,497.31	1,319,814.20	20,085,355.27	37,866,643.05
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur vente de titres	2	1,204,309.19	-1,968,694.15	-50,402,451.02	-75,806,844.31
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur contrats de change à terme	2	-	-	-	-
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur "futures"	2	-	-	-	-
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur swaps	2	-20,165,908.38	1,631,545.89	132,417,468.85	77,522,429.44
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur change	2	16,736,912.08	17,497,679.38	32,406,488.54	53,495,893.35
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e)		-708,189.80	18,480,345.32	134,506,861.64	93,078,121.53
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur portefeuille-titres		-36,053,082.80	-47,442,835.46	-158,592,958.46	-201,788,156.48
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur contrats de change à terme		-	-	-	-
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur "futures"		-	-	-	-
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur swaps		-1,427,178.91	903,716.33	-2,090,912.26	-15,435,452.93
Résultat des opérations		-38,188,451.51	-28,058,773.81	-26,177,009.08	-124,145,487.88
Dividendes payés	9	-	-	-	-
Souscriptions		29,320,405.54	562,318,532.93	464,946,374.52	536,016,211.67
Rachats		-105,121,170.08	-169,524,192.30	-946,076,766.44	-167,759,499.00
Augmentation/(diminution) des actifs nets		-113,989,216.05	364,735,566.82	-507,307,401.00	244,111,224.79
Réévaluation de la balance d'ouverture		-	-	-	-
Actifs nets au début de l'année		289,428,561.53	234,021,544.49	1,268,661,605.64	1,777,790,336.05
Actifs nets à la fin de l'année		175,439,345.48	598,757,111.31	761,354,204.64	2,021,901,560.84

AMUNDI MSCI WORLD ENERGY	AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE	AMUNDI MSCI WORLD FINANCIALS	AMUNDI RUSSELL 2000	AMUNDI S&P 500	AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY	AMUNDI SMART CITY	AMUNDI SMART FACTORY
30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR
758,846.85	2,258,431.19	755,078.02	2,816,836.68	39,965,073.39	753,420.78	337,948.46	197,494.63
756,758.56	2,251,484.23	754,431.16	2,812,955.60	39,873,975.98	749,171.60	337,687.35	196,751.61
-	-	-	-	-	-	-	-
7.94	-	11.51	-	5,523.11	27.52	14.38	-
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	79.21
2,080.35	6,946.96	635.35	3,881.08	85,574.30	4,221.66	246.73	663.81
345,076.11	1,511,799.11	624,013.07	617,058.47	12,926,276.96	868,611.15	113,648.59	154,089.96
243,419.38	1,062,632.95	439,270.73	439,520.62	5,006,736.99	510,398.07	80,498.23	109,116.14
97,367.78	425,053.22	175,708.14	175,808.37	7,244,403.69	340,265.44	32,199.25	43,646.38
4,251.09	23,912.02	8,952.32	1,553.52	640,871.45	17,844.28	905.17	1,278.05
37.86	200.92	81.88	175.96	14,997.78	103.36	45.94	49.39
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	19,267.05	-	-	-
413,770.74	746,632.08	131,064.95	2,199,778.21	27,038,796.43	-115,190.37	224,299.87	43,404.67
-2,168,300.15	-38,444,045.33	-19,261,218.31	-854,314.81	-349,844,107.59	-42,625,101.13	5,254,582.44	7,189,524.49
-	-	172,494.79	-	12,102,498.55	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
45,016,810.36	82,009,564.64	3,012,707.94	-6,463,682.28	-237,412,650.67	-10,110,905.26	-5,942,027.16	-11,054,190.35
6,434,113.76	51,347,052.28	22,807,594.58	3,074,509.09	859,845,932.41	35,957,080.42	2,950,771.43	3,888,141.34
49,696,394.71	95,659,203.67	6,862,643.95	-2,043,709.79	311,730,469.13	-16,894,116.34	2,487,626.58	66,880.15
-13,058,253.79	-65,819,265.33	-11,706,983.85	-17,327,974.71	-458,630,518.49	-33,536,168.89	-6,986,585.88	-9,050,973.25
-	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
-3,114.80	-47,100,370.55	-684,871.02	-835,664.38	-24,637,252.14	3,808,792.69	-227,549.36	-104,938.88
36,635,026.12	-17,260,432.21	-5,529,210.92	-20,207,348.88	-171,537,301.50	-46,621,492.54	-4,726,508.66	-9,089,031.98
-	-	-	-	-	-	-	-
60,975,225.24	58,727,116.29	49,902,024.31	52,851,405.44	3,610,356,388.47	164,089,546.69	-	11,995,645.92
-100,216,657.11	-31,208,035.88	-100,914,207.29	-81,193,560.38	-3,641,106,542.54	-66,148,994.44	-56,943,752.86	-44,303,398.08
-2,606,405.75	10,258,648.20	-56,541,393.90	-48,549,503.82	-202,287,455.57	51,319,059.71	-61,670,261.52	-41,396,784.14
-	-	-	-	-	-	-	-
93,429,676.71	392,095,933.63	182,337,732.87	189,714,234.22	6,534,539,403.97	276,232,649.07	75,759,465.73	69,927,999.33
90,823,270.96	402,354,581.83	125,796,338.97	141,164,730.40	6,332,251,948.40	327,551,708.78	14,089,204.21	28,531,215.19

	Note	AMUNDI STOXX GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE	AMUNDI DAX 50 ESG	AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG	AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB
Français		30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR
Revenus		1,914,500.91	388,084.66	3,852,850.80	59,168,565.18
Dividendes nets	2	1,911,281.99	387,275.63	3,838,396.62	59,006,773.21
Intérêts sur obligations	2	-	-	-	-
Intérêts bancaires	2	49.33	14.10	197.50	3,135.21
Intérêts sur prises en pension	6	-	759.34	11,539.16	112,667.79
Intérêts reçus sur swaps		-	-	-	-
Autres revenus		3,169.59	35.59	2,717.52	45,988.97
Dépenses		1,350,072.50	19,207.08	621,146.79	9,261,038.58
Commissions de gestion	4	952,517.61	2,918.67	118,316.01	1,346,446.43
Frais administratifs	4	381,007.08	11,674.85	172,634.26	1,964,982.68
Frais de transactions	2	15,839.00	4,420.24	327,682.21	5,900,240.30
Intérêts bancaires & charges similaires		201.53	193.32	2,465.47	45,196.44
Intérêts payés sur swaps		-	-	-	-
Autres dépenses		507.28	-	48.84	4,172.73
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur investissements		564,428.41	368,877.58	3,231,704.01	49,907,526.60
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur vente de titres	2	-26,852,542.31	-20,186.26	4,626,619.50	149,954,512.81
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur contrats de change à terme	2	-	-	-	-
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur "futures"	2	-	-8,051.01	-103,120.00	-1,605,077.72
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur swaps	2	-44,222,467.90	-	3,895,604.42	-93,632,840.28
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur change	2	47,394,676.01	317.33	6,897,389.77	93,553,652.21
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e)		-23,115,905.79	340,957.64	18,548,197.70	198,177,773.62
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur portefeuille-titres		-42,457,440.35	-3,671,923.33	-37,963,773.65	-407,485,330.19
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur contrats de change à terme		-	-	-	-
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur "futures"		-	-3,088.50	-85,210.00	-303,472.23
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur swaps		539,594.56	-	-1,273,548.82	-39,156,899.20
Résultat des opérations		-65,033,751.58	-3,334,054.19	-20,774,334.77	-248,767,928.00
Dividendes payés	9	-	-	-	-
Souscriptions		93,922,910.49	10,342,402.29	34,192,981.95	472,774,096.85
Rachats		-23,146,292.71	-1,213,540.24	-55,218,129.13	-1,200,643,540.30
Augmentation/(diminution) des actifs nets		5,742,866.20	5,794,807.86	-41,799,481.95	-976,637,371.45
Réévaluation de la balance d'ouverture		-	-	-	-
Actifs nets au début de l'année		329,400,687.19	6,678,669.47	187,447,360.74	2,677,983,760.46
Actifs nets à la fin de l'année		335,143,553.39	12,473,477.33	145,647,878.79	1,701,346,389.01

AMUNDI BBB EURO CORPORATE INVESTMENT GRADE ESG	AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE ESG	AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX	AMUNDI GOVT BOND EURO BROAD INVESTMENT GRADE	AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE	AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE 1-3	AMUNDI US TREASURY 1-3	AMUNDI US TREASURY 3-7
30/09/22 EUR	30/09/22 USD	30/09/22 USD	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 EUR	30/09/22 USD	30/09/22 USD
1,212,326.72	24,067,640.10	9,275,641.69	7,670,700.43	19,043,648.39	3,032,588.79	672,215.81	218,378.86
750.00	-	-	-	-	-	-	-
1,210,442.06	23,828,958.91	9,261,644.36	7,589,885.85	18,991,949.97	3,025,885.72	668,534.84	217,698.00
134.39	221,246.80	2,616.97	75.27	18.79	17.29	441.57	116.43
-	-	10,152.32	80,589.67	51,384.18	6,569.41	3,239.40	564.43
-	-	-	-	-	-	-	-
1,000.27	17,434.39	1,228.04	149.64	295.45	116.37	-	-
152,425.23	3,537,396.26	547,539.73	573,595.48	1,272,409.32	185,891.24	65,201.49	18,449.10
79,675.13	1,593,104.60	373,870.76	182,784.31	407,565.27	59,465.02	21,072.51	5,950.45
52,369.72	1,160,606.93	127,663.13	284,331.05	633,990.29	92,501.22	32,516.12	9,209.56
17,668.33	408,395.40	45,808.60	101,546.82	226,430.12	33,036.11	11,612.86	3,289.09
2,702.38	375,289.33	197.24	4,862.69	4,423.64	831.72	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
9.67	-	-	70.61	-	57.17	-	-
1,059,901.49	20,530,243.84	8,728,101.96	7,097,104.95	17,771,239.07	2,846,697.55	607,014.32	199,929.76
-9,141,526.23	-9,823,458.81	-25,322,169.70	-20,533,527.87	-81,605,529.21	-3,790,092.55	-1,237,088.72	-364,258.76
-	-172,163,107.71	-	-	-	-	-	-
-42,420.00	-	22,593.75	-	-	-	-	-
450,876.95	-6,767,358.70	-	-	-	-	-	-
-	31,089,606.54	-56.72	-	-	-	-	-
-7,673,167.79	-137,134,074.84	-16,571,530.71	-13,436,422.92	-63,834,290.14	-943,395.00	-630,074.40	-164,329.00
-4,419,532.48	-14,544,257.27	-25,997,472.72	-58,605,663.13	-96,163,812.86	-5,471,774.61	-1,818,174.88	-1,410,565.93
-	-20,031,230.81	-	-	-	-	-	-
-11,810.00	-	-	-	-	-	-	-
-28,739.50	2,478,827.49	-	-	-	-	-	-
-12,133,249.77	-169,230,735.43	-42,569,003.43	-72,042,086.05	-159,998,103.00	-6,415,169.61	-2,448,249.28	-1,574,894.93
-	-	-	-	-3,802,935.00	-	-	-
89,442,072.40	969,376,827.94	88,181,080.00	133,828,940.00	455,689,275.24	63,420,290.00	50,657,680.00	21,837,350.00
-157,663,670.00	-778,231,365.85	-118,504,352.88	-286,015,270.00	-1,049,463,214.77	-95,574,750.00	-71,053,370.00	-13,513,875.00
-80,354,847.37	21,914,726.66	-72,892,276.31	-224,228,416.05	-757,574,977.53	-38,569,629.61	-22,843,939.28	6,748,580.07
-	-	-	-	-	-	-	-
131,398,005.42	1,488,063,778.35	219,191,579.87	529,672,410.21	1,210,800,842.90	150,163,162.14	82,461,753.48	10,004,709.14
51,043,158.05	1,509,978,505.01	146,299,303.56	305,443,994.16	453,225,865.37	111,593,532.53	59,617,814.20	16,753,289.21

	Note	AMUNDI US TREASURY 7-10	Consolidé
		30/09/22 USD	30/09/22 EUR
Français			
Revenus		6,918,643.50	1,653,545,085.42
Dividendes nets	2	-	1,288,017,099.88
Intérêts sur obligations	2	6,785,324.65	352,335,352.77
Intérêts bancaires	2	19,656.26	2,525,998.39
Intérêts sur prises en pension	6	113,662.59	8,171,323.08
Intérêts reçus sur swaps		-	1,320,925.00
Autres revenus		-	1,174,386.30
Dépenses		609,012.91	219,103,825.33
Commissions de gestion	4	180,030.01	77,891,483.07
Frais administratifs	4	279,316.15	85,959,993.66
Frais de transactions	2	99,755.77	53,069,888.47
Intérêts bancaires & charges similaires		49,910.98	2,124,335.51
Intérêts payés sur swaps		-	5,707.81
Autres dépenses		-	52,416.80
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur investissements		6,309,630.59	1,434,441,260.09
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur vente de titres	2	-38,642,995.29	-590,665,812.42
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur contrats de change à terme	2	-37,994,963.38	-922,445,750.37
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur "futures"	2	-	-32,485,969.62
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur swaps	2	-	-1,283,207,828.10
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e) sur change	2	8,465,150.94	2,473,961,172.99
Bénéfice/(perte) net(te) réalisé(e)		-61,863,177.14	1,079,597,072.56
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur portefeuille-titres		-53,333,037.34	-17,000,795,594.61
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur contrats de change à terme		-10,365,271.80	-33,627,652.09
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur "futures"		-	-8,126,048.16
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur swaps		-	-143,103,497.68
Résultat des opérations		-125,561,486.28	-
Dividendes payés	9	-	-122,788,761.18
Souscriptions		1,109,484,498.97	57,787,775,308.57
Rachats		-673,983,385.31	-48,357,492,871.35
Augmentation/(diminution) des actifs nets		309,939,627.38	-6,798,562,043.93
Réévaluation de la balance d'ouverture		-	5,396,780,587.45
Actifs nets au début de l'année		238,238,460.61	88,898,023,061.92
Actifs nets à la fin de l'année		548,178,087.99	87,496,241,605.44

1 ACTIVITÉ

Créée en date du 9 juin 2016, Amundi Index Solutions (la « SICAV ») a la structure d'une société anonyme et est qualifiée comme « Société d'investissement à Capital Variable » (« SICAV ») en vertu des lois du Grand-Duché de Luxembourg. Les statuts constitutifs (les « Statuts ») ont été initialement publiés dans l'extrait Recueil des Sociétés et Associations, le 17 juin 2016.

LA SICAV est soumise à la section I de la loi du 17 décembre 2010 dans sa version modifiée, relative aux organismes de placement collectif.

La SICAV est enregistrée sous le numéro B 206.810 au registre du commerce du Luxembourg, dans lequel ses statuts sont disponibles à des fins d'inspection. Une copie de ceux-ci peut être remise sur demande.

Le capital de la SICAV est représenté par la somme des actifs nets de tous les compartiments.

Au 30 septembre 2022, les compartiments suivants étaient actifs :

AMUNDI CAC 40 ESG
 AMUNDI EURO STOXX 50
 AMUNDI JAPAN TOPIX
 AMUNDI JPX-NIKKEI 400
 AMUNDI MSCI BRAZIL
 AMUNDI MSCI CHINA
 AMUNDI MSCI EASTERN EUROPE EX RUSSIA
 AMUNDI MSCI EM ASIA
 AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA
 AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS
 AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND
 AMUNDI MSCI INDIA
 AMUNDI MSCI NORDIC
 AMUNDI MSCI SWITZERLAND
 AMUNDI MSCI USA
 AMUNDI MSCI WORLD
 AMUNDI MSCI WORLD ENERGY
 AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE
 AMUNDI MSCI WORLD FINANCIALS
 AMUNDI RUSSELL 2000
 AMUNDI S&P 500
 AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY
 AMUNDI SMART CITY
 AMUNDI SMART FACTORY
 AMUNDI STOXX GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE
 AMUNDI DAX 50 ESG
 AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG
 AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB
 AMUNDI BBB EURO CORPORATE INVESTMENT GRADE
 AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE ESG
 AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKET IBOXX
 AMUNDI GOVT BOND EURO BROAD INVESTMENT GRADE
 AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EUROMTS INVESTMENT GRADE
 AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EUROMTS INVESTMENT GRADE 1-3
 AMUNDI US TREASURY 1-3
 AMUNDI US TREASURY 3-7
 AMUNDI US TREASURY 7-10

2 SYNTHÈSE DES PRINCIPALES CONVENTIONS COMPTABLES

■ PRÉSENTATION DES ÉTATS FINANCIERS

Les états financiers de la SICAV sont établis conformément aux prescriptions réglementaires en vigueur au Luxembourg relatives aux organismes de placement collectif.

L'état combiné de l'actif net et l'état combiné des opérations englobent tous les compartiments de la SICAV. Par conséquent, le total des compartiments enregistrés à la vente en Suisse et présentés dans le présent rapport ne concorde pas avec les comptes combinés présentés.

■ POLITIQUE DE VALORISATION

- **Portefeuille de titres** - Les valeurs mobilières, les instruments du marché monétaire et les produits dérivés admis à la cotation ou négociés sur un marché boursier ou négocié sur tout autre marché réglementé sont généralement valorisés au dernier cours du marché disponible le jour ouvré concerné. Les titres non cotés, ou les titres cotés dont le prix déterminé selon la méthode ci-dessus n'est pas représentatif de leur juste valeur de marché, sont valorisés de bonne foi selon une estimation prudente de leur prix de vente. Les produits dérivés qui ne sont pas cotés sur un marché boursier officiel ou qui sont négociés de gré à gré sont valorisés quotidiennement de manière fiable et vérifiable conforme aux pratiques du marché.

2 SYNTHÈSE DES PRINCIPALES CONVENTIONS COMPTABLES (suite)

- **Valorisation des contrats d'échange** - Les contrats d'échange de rendement total (contrats par lesquels l'une des parties cède à l'autre partie la performance totale d'un actif de référence, y compris tous les intérêts, revenus de commissions, gains ou pertes du marché et pertes de crédit). Les contrats d'échange de rendement total conclus par les compartiments prennent la forme de contrats d'échange non financés, c'est-à-dire de contrats d'échange n'impliquant aucun paiement initial à la conclusion du contrat par la partie qui reçoit le rendement total. Les contrats d'échange sont évalués à la valeur nette actuelle de leurs flux de trésorerie. Les intérêts à recevoir sur contrats d'échange sont repris à la rubrique « Intérêts à recevoir sur contrats d'échange » de l'État de l'actif net, tandis que les intérêts à payer sur contrats d'échange sont repris à la rubrique « Intérêts à payer sur contrats d'échange » de l'État de l'actif net.
- **Valorisation des contrats de change à terme** - Les contrats de change à terme (forwards de change) en cours sont évalués à la date de clôture en fonction du taux de change applicable à la durée de vie restante du contrat. La plus-value ou moins-value latente des contrats de change à terme est communiquée dans les comptes.
- **Valorisation des marchés à terme** - La SICAV a conclu une série de marchés à terme (« futures ») au cours de l'année. À la fin de l'année, les contrats en cours sont évalués à leur valeur liquidative nette sur la base du cours de clôture du marché boursier sur lequel ces contrats sont négociés. La variation des plus-values ou moins-values latentes est indiquée dans l'État des opérations et des variations de l'Actif net.
- **Swing pricing** - Les jours ouvrés où il estime que la négociation des actions d'un compartiment nécessitera des ventes ou des achats significatifs d'investissements du portefeuille, le Conseil d'administration peut ajuster la VNI du compartiment afin de refléter plus fidèlement les prix réels des transactions sous-jacentes sur la base des écarts de négociation estimés, des coûts et d'autres facteurs de marché et de négociation. De manière générale, la VNI sera ajustée à la hausse en cas de forte demande d'achats d'actions d'un compartiment et à la baisse en cas de forte demande de remboursements d'actions d'un compartiment. L'ajustement ne dépassera normalement pas 2 % de la VNI pour un jour ouvré donné, mais le Conseil d'administration peut augmenter cette limite si nécessaire pour protéger les intérêts des actionnaires.

Au cours de l'exercice financier, les fonds suivants faisaient partie du champ d'application du mécanisme d'ajustement de la valeur liquidative Swing-pricing :

Compartiments faisant partie du champ d'application du mécanisme de swing pricing	Compartiments ayant appliqué le swing pricing en cours d'exercice	Compartiments ayant fait l'objet d'un swing pricing au 30 septembre 2022
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB	X	X

En date du 30 septembre 2022, aucun ajustement par swing pricing n'a été appliqué.

Le facteur de swing est le montant par lequel la VNI est ajustée lorsque le processus de swing pricing est déclenché après le dépassement du seuil de swing par les souscriptions ou rachats nets. Les facteurs à prendre en considération pour fixer le facteur de swing sont notamment les commissions de courtage nettes payées par le compartiment et les charges fiscales (par ex. droit de timbre et taxe à la vente).

Pour l'exercice clos le 30 septembre 2022, les facteurs de swing maximums ont été appliqués aux compartiments suivants :

Compartiments	Facteur de swing maximal sur entrées (%)	Facteur de swing maximal sur sorties (%)
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB	0,191	0,010

- **Conversion d'éléments libellés en devises étrangères** - les dépôts bancaires, les autres actifs nets ainsi que la valeur des titres en portefeuille libellés dans des devises autres que la devise de référence du compartiment sont convertis dans la devise de référence du compartiment au taux de change en vigueur à la date de clôture. Les produits et charges libellés dans une devise autre que la devise de référence du compartiment sont convertis dans la devise de référence du compartiment sur la base des taux de change en vigueur à la date de comptabilisation.

Les états financiers combinés sont exprimés en euros (EUR) et son calculés en additionnant l'actif net de tous les compartiments.

Le taux de change utilisé pour les chiffres cumulés est le suivant :

1 EUR = 1,15895 USD
 1 EUR = 129,30985 JPY
 1 EUR = 0,85955 GBP

- **Revenus de dividendes et d'intérêts** - Le revenu de dividende est enregistré à la date ex-dividende et hors retenue fiscale à la source. Le revenu des intérêts est enregistré selon la comptabilité d'engagement.
- **Plus-value ou moins-value nette réalisée sur la vente de titres d'investissement** - La plus-value/(moins-value) nette réalisée sur la vente de titres d'investissement est déterminée sur la base du coût moyen des titres vendus.

2 SYNTHÈSE DES PRINCIPALES CONVENTIONS COMPTABLES (suite)

■ POLITIQUE DE DIVIDENDE

Les actions de distribution distribueront tout ou partie du revenu d'investissement net reçu par le compartiment concerné, et peuvent également distribuer des plus-values de capital (latentes et réalisées) ainsi que du capital. Lorsqu'un dividende est déclaré, la VNI de la catégorie concernée est réduite du montant du dividende. Les dividendes peuvent être déclarés sur base annuelle, trimestrielle ou mensuelle, comme indiqué par le suffixe de la catégorie d'actions (QD, MD, YD). Ces actions fixent un montant de dividende cible communiqué par avance. Il s'agit d'un montant que le compartiment aspire à verser mais ne garantit pas. Les dividendes cibles peuvent être indiqués sous la forme d'un montant spécifique ou d'un pourcentage de la VNI. Pour pouvoir verser le montant du dividende cible, il peut arriver qu'un compartiment verse en dividende un montant supérieur au montant réellement gagné, ce qui signifie que les investisseurs récupèrent une partie de leur capital sous forme de dividende.

Pour de plus amples informations concernant le calendrier et les objectifs de dividendes, veuillez consulter amundi.com et/ou amundi.tff.com.

Les catégories d'actions dépourvues de suffixe (QD, MD ou YD) déclarent un dividende annuel en février.

Des dividendes supplémentaires peuvent être déclarés sur décision du Conseil d'administration.

Les dividendes des actions de distribution sont réinvestis automatiquement ou versés selon les coordonnées bancaires en possession d'Amundi pour le compte des Actionnaires. Les dividendes de chaque catégorie d'actions sont payés dans la devise de la dividende concernée. Les Actionnaires peuvent demander la conversion de leurs dividendes dans une devise différente. Si la devise demandée fait partie des devises acceptées par le compartiment, il n'y a typiquement pas de frais de change. Dans les autres cas, les Actionnaires se verront généralement facturer les frais de change en vigueur.

Les paiements de dividendes non réclamés sont restitués au compartiment au bout de cinq ans. Les dividendes sont payés uniquement sur les actions détenues à la date d'enregistrement.

Aucun compartiment n'effectuera de paiement de dividende si les actifs de la SICAV sont inférieurs aux exigences de fonds propres ou si le paiement de dividendes est susceptible de réduire le capital à un niveau inférieur aux exigences de fonds propres.

■ FRAIS DE TRANSACTION

Les frais de transaction incluent les frais découlant de l'encodage de chaque nouvelle opération (achat ou vente) par le service dédié de CACEIS Bank, filiale de Luxembourg, les commissions de forex, les commissions des marchés boursiers et les frais de traitement relatifs aux opérations sur les titres en portefeuille et sur les contrats de change à terme. Les frais de transaction sont indiqués à la rubrique « Frais de transaction ».

■ PRETS ET EMPRUNTS DE TITRES

Dans les opérations de prêt et d'emprunt de titres, un prêteur transfère des titres ou des instruments à un emprunteur à la condition que cet emprunteur s'engage à rendre des titres ou instruments équivalents à une date future ou lorsque le prêteur en fait la demande. Dans le cadre d'opérations de ce type, un compartiment peut prêter des titres ou des instruments à n'importe quelle contrepartie soumise à des règles de surveillance prudentielle que la CSSF considère comme équivalentes à celles prescrites par la législation de l'UE.

Un compartiment peut prêter des titres en portefeuille directement ou par l'intermédiaire :

- d'un système de prêt standardisé organisé par une chambre de compensation reconnue ;
- d'un système de prêt organisé par une institution financière spécialisée dans les opérations de ce type.

L'emprunteur doit constituer une garantie valable pendant toute la durée du prêt et au moins égale à la valorisation totale des titres prêtés majorée de la valeur de toute décote jugée appropriée au vu de la qualité de la garantie.

Les éléments de revenus sur prêt de titres présentés dans l'état des opérations et des variations de l'actif net sont indiqués sur une base nette, soit le revenu brut après déduction des frais directs et indirects à proportion de 35 %. Le revenu brut est enregistré selon la comptabilité d'engagement tandis que les frais sont déduits mensuellement sur la base des encaissements/décaissements. L'exécution des transactions EPM a été confiée à Amundi Intermediation et CACEIS qui sont des parties liées.

■ ABRÉVIATION

XX, XX/XXA et XX.XX.XX RIGHT : Obligations perpétuelles

3 TAXE D'ABONNEMENT

La SICAV est normalement soumise à une taxe d'abonnement. Pour les compartiments indexés (avec actions cotées), la SICAV est exonérée de la taxe d'abonnement conformément à l'article 175(e) de la Loi de 2010.

La SICAV n'est actuellement soumise à aucun autre impôt sur le revenu ou les plus-values.

Les informations fiscales sont exactes à la connaissance du Conseil d'administration, mais il est possible que l'autorité fiscale impose de nouveaux impôts (y compris rétroactifs).

4 FRAIS DE GESTION ET FRAIS ADMINISTRATIFS

Amundi Luxembourg S.A. a droit à recevoir de la SICAV les commissions de gestion calculées pour chaque Compartiment. Ces commissions sont calculées et acquises chaque Jour de négociation et payables trimestriellement à terme échu. Amundi Luxembourg S.A. est responsable du paiement des commissions aux gestionnaires d'investissement, aux prestataires de services et aux distributeurs.

La commission d'administration est une commission exprimée en pourcentage de la VNI des compartiments et des catégories d'actions, payable mensuellement à terme échu à Amundi Luxembourg S.A. et calculée chaque jour.

Les taux de commissions de gestion ainsi que les frais administratifs annuels appliqués au 30 septembre 2021 sont précisés ci-dessous :

Compartiments	Classes d'action	Frais de gestion	Frais administratifs
AMUNDI CAC 40 ESG	UCITS ETF DR	0,125	0,100
AMUNDI EURO STOXX 50	UCITS ETF DR EUR	0,025	0,100
	UCITS ETF DR USD	0,025	0,100
AMUNDI JAPAN TOPIX	UCITS ETF DAILY HEDGED CHF	0,380	0,100
	UCITS ETF DAILY HEDGED EUR	0,380	0,100
	UCITS ETF DAILY HEDGED GBP	0,380	0,100
	UCITS ETF DAILY HEDGED USD	0,380	0,100
	UCITS ETF EUR	0,100	0,100
	UCITS ETF JPY	0,100	0,100
AMUNDI JPX-NIKKEI 400	UCITS ETF DAILY HEDGED CHF	0,080	0,100
	UCITS ETF DAILY HEDGED EUR	0,080	0,100
	UCITS ETF DAILY HEDGED GBP	0,080	0,100
	UCITS ETF DAILY HEDGED USD	0,080	0,100
	UCITS ETF EUR	0,080	0,100
	UCITS ETF JPY	0,080	0,100
AMUNDI MSCI BRAZIL	UCITS ETF	0,450	0,100
AMUNDI MSCI CHINA	UCITS ETF EUR	0,450	0,100
	UCITS ETF USD	0,450	0,100
AMUNDI MSCI EASTERN EUROPE EX RUSSIA	UCITS ETF EUR	0,100	0,100
	UCITS ETF USD	0,100	0,100
AMUNDI MSCI EM ASIA	UCITS ETF EUR	0,100	0,100
	UCITS ETF USD	0,100	0,100
AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA	UCITS ETF EUR	0,100	0,100
	UCITS ETF USD	0,100	0,100
AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS	UCITS ETF EUR	0,100	0,100
	UCITS ETF USD	0,100	0,100
AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND	UCITS ETF EUR	0,100	0,100
AMUNDI MSCI INDIA	UCITS ETF EUR	0,700	0,100
	UCITS ETF USD	0,700	0,100
AMUNDI MSCI NORDIC	UCITS ETF EUR	0,150	0,100
AMUNDI MSCI SWITZERLAND	UCITS ETF CHF	0,150	0,100
	UCITS ETF EUR	0,150	0,100
AMUNDI MSCI USA	UCITS ETF EUR	0,180	0,100
	UCITS ETF USD	0,180	0,100
AMUNDI MSCI WORLD	UCITS ETF EUR	0,280	0,100
	UCITS ETF USD	0,280	0,100
AMUNDI MSCI WORLD ENERGY	UCITS ETF EUR	0,250	0,100
AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE	UCITS ETF EUR	0,250	0,100
	UCITS ETF USD	0,250	0,100

4 FRAIS DE GESTION ET FRAIS ADMINISTRATIFS (suite)

Compartiments	Classes d'action	Frais de gestion	Frais administratifs
AMUNDI MSCI WORLD FINANCIALS	UCITS ETF EUR	0,250	0,100
	UCITS ETF USD	0,250	0,100
AMUNDI RUSSELL 2000	UCITS ETF EUR	0,250	0,100
	UCITS ETF USD	0,250	0,100
AMUNDI S&P 500	UCITS ETF DAILY HEDGED EUR	0,180	0,100
	UCITS ETF EUR	0,050	0,100
	UCITS ETF USD	0,050	0,100
AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY	UCITS ETF EUR	0,150	0,100
	UCITS ETF USD	0,150	0,100
AMUNDI SMART CITY	UCITS ETF EUR	0,250	0,100
AMUNDI SMART FACTORY	UCITS ETF EUR	0,250	0,100
AMUNDI STOXX GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE	UCITS ETF	0,250	0,100
AMUNDI DAX 50 ESG	UCITS ETF DR	0,025	0,100
AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG	UCITS ETF EUR	0,055	0,100
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB	I14E	0,010	0,025
	UCITS ETF DR	0,015	0,080
AMUNDI BBB EURO CORPORATE INVESTMENT GRADE	UCITS ETF	0,105	0,070
AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE ESG	UCITS ETF DR USD	0,085	0,070
	UCITS ETF DR HEDGED EUR	0,105	0,070
	UCITS ETF DR HEDGED MXN	0,045	0,070
	UCITS ETF DR USD	0,205	0,070
AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX	UCITS ETF DR USD	0,205	0,070
AMUNDI GOVT BOND EURO BROAD INVESTMENT GRADE	UCITS ETF	0,045	0,070
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE	UCITS ETF	0,045	0,070
AMUN GOVT BD LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE 1-3	UCITS ETF	0,045	0,070
AMUNDI US TREASURY 1-3	UCITS ETF	0,045	0,070
AMUNDI US TREASURY 3-7	UCITS ETF	0,045	0,070
AMUNDI US TREASURY 7-10	UCITS ETF DR HEDGED EUR	0,045	0,070
	UCITS ETF DR USD	0,045	0,070

5 SWAPS

Au 30 septembre 2022, les positions ouvertes sur des contrats d'échange de rendement total étaient les suivantes.

Les compartiments suivants échangent la performance de leur portefeuille contre la performance de l'indice indiqué sous « Exposition sous-jacente ».

■ **AMUNDI JAPAN TOPIX**

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
1.834.906.582,84	EUR	31/05/2023	Topix Index	2.098.672,81

■ **AMUNDI JPX NIKKEI 400**

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
499.068.052,38	EUR	31/05/2023	JPY-NIKKEI 400 Index	491.030,32

5 SWAPS (suite)■ **AMUNDI MSCI BRAZIL**

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in USD)
8.315.484,23	USD	31/05/2023	MSCI Brazil Index	51.756,21

■ **AMUNDI MSCI CHINA**

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
83.485.926,92	EUR	31/05/2023	MSCI China H Index	363.428,46

■ **AMUNDI MSCI EASTERN EUROPE EX RUSSIA**

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
18.014.319,34	EUR	31/05/2023	MSCI Eastern Europe Ex Russia Index	-9.301,45

■ **AMUNDI MSCI EM ASIA**

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
1.881.849.703,37	EUR	31/05/2023	MSCI Emerging Markets Asia Index	30.926.253,24

■ **AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA**

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
272.273.915,84	EUR	31/05/2023	MSCI Emerging Markets Latam Index	3.230.105,14

■ **AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS**

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
2.789.362.836,20	EUR	31/05/2023	MSCI Emerging Markets Index	39.279.970,84

■ **AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND**

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
200.999.476,40	EUR	31/05/2023	MSCI Europe EX Switzerland Index	3.594.383,47

■ **AMUNDI MSCI INDIA**

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
146.345.392,26	EUR	31/05/2023	MSCI India Index	2.356.382,43

5 SWAPS (suite)

■ AMUNDI MSCI NORDIC

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
176.554.346,02	EUR	31/05/2023	MSCI Nordic countries Index	2.378.227,13

■ AMUNDI MSCI SWITZERLAND

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
600.601.601,34	EUR	31/05/2023	MSCI Switzerland Index	3.489.754,01

■ AMUNDI MSCI USA

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
775.078.879,17	EUR	31/05/2023	MSCI Usa Index	-14.311.753,92

■ AMUNDI MSCI WORLD

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
2.077.009.373,34	EUR	31/05/2023	MSCI World Index	-28.835.777,92

■ AMUNDI MSCI WORLD ENERGY

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
102.628.661,86	EUR	31/05/2023	MSCI World Energy Index	641.834,16

■ AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
446.848.453,20	EUR	31/05/2023	MSCI World Ex Europe Index	-48.347.199,12

■ AMUNDI MSCI WORLD FINANCIALS

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
136.015.593,38	EUR	31/05/2023	MSCI World Financials Index	419.454,16

■ AMUNDI RUSSELL 2000

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
150.307.039,49	EUR	31/05/2023	Russell 2000 Index	-2.003.502,68

5 SWAPS (suite)

■ AMUNDI S&P 500

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
12.975.626.623,40	EUR	31/05/2023	S&P 500 Index	-62.596.119,57

■ AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
373.019.330,54	EUR	31/05/2023	S&P Global Luxury Index	4.757.196,29

■ AMUNDI SMART CITY

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (en EUR)
15.109.860,35	EUR	31/05/2023	Solactive Smart City Index	60.691,51

■ AMUNDI SMART FACTORY

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (en EUR)
35.004.932,63	EUR	31/05/2023	Solactive Smart Factory Index	-7.313,90

■ AMUNDI STOXX GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE

Montant nominal	Devise	Date d'échéance	Exposition sous-jacente	Plus ou (moins)-value non réalisée (in EUR)
346.383.167,86	EUR	31/05/2023	STOXX AI Global Artificial Intelligence ADTV5 Index	293.542,60

Les contreparties des contrats d'échange sont indiquées à la note RÈGLEMENT RELATIF À LA TRANSPARENCE DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA RÉUTILISATION (« SFTR »).

6 CONTRATS DE PRISES EN PENSION

Au 30 septembre 2022, la SICAV est engagée dans des conventions de prêt de titres entièrement garanties conclues avec une institution financière de premier plan selon les conditions suivantes:

Compartiment	Devise du compartiment	Valeur de marché des titres prêtés dans la devise du compartiment	Garantie Cash	Garantie Securities
AMUNDI CAC 40 ESG	EUR	129.762.247,29	135.089.473,21	-
AMUNDI EURO STOXX 50	EUR	378.349.030,37	198.519.500,00	188.004.030,40
AMUNDI DAX 50 ESG	EUR	1.997.324,89	2.040.335,00	-
AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG	EUR	22.630.551,56	23.098.724,12	-
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB	EUR	272.928.681,26	278.414.391,79	-
AMUNDI GOVT BOND EURO BROAD INVESTMENT GRADE	EUR	124.105.874,42	42.408.878,00	86.104.052,54
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE	EUR	38.597.194,31	17.266.773,00	22.619.660,14
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE 1-3	EUR	24.017.006,07	9.096.835,00	15.719.862,48
AMUNDI US TREASURY 1-3	USD	9.563.465,07	9.978.793,27	-
AMUNDI US TREASURY 3-7	USD	974.244,91	1.009.203,10	12.643,37
AMUNDI US TREASURY 7-10	USD	245.711.860,73	54.622.236,31	204.700.484,57

6 CONTRATS DE PRISES EN PENSION (suite)

Les contreparties des opérations de prêt de titres sont indiquées à la note RÈGLEMENT RELATIF À LA TRANSPARENCE DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA RÉUTILISATION (« SFTR »).

Il n'y a pas de réinvestissement des garanties en espèces ou sur titres.

Pour l'exercice clos au 30 septembre 2022, le montant des revenus de prêt de titres généré par la SICAV est repris dans l'État des opérations à la rubrique « Revenu de prêt de titres ». Il se présente comme suit :

Compartiments	Devises	Montant brut total des revenus des prêts de titres	Coûts et frais directs et indirects		Montant total net des revenus des prêts de titres
			Amundi Intermédiation. Paris	Caceis Bank. Luxembourg Branch	
AMUNDI CAC 40 ESG	EUR	250.330,12	75.180,93	12.530,16	162.619,03
AMUNDI EURO STOXX 50	EUR	804.797,49	241.435,80	40.239,30	523.122,39
AMUNDI DAX 50 ESG	EUR	1.168,46	350,67	58,45	759,34
AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG	EUR	17.752,50	5.325,72	887,62	11.539,16
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB	EUR	173.327,23	51.993,81	8.665,63	112.667,79
AMUNDI GOVT BOND EURO BROAD INVESTMENT GRADE	EUR	134.703,47	46.383,26	7.730,54	80.589,67
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE	EUR	79.052,59	23.715,78	3.952,63	51.384,18
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE 1-3	EUR	10.106,83	3.032,07	505,35	6.569,41
AMUNDI US TREASURY 1-3	USD	5.122,52	1.614,10	269,02	3.239,40
AMUNDI US TREASURY 3-7	USD	869,64	261,61	43,60	564,43
AMUNDI US TREASURY 7-10	USD	178.983,00	55.988,92	9.331,49	113.662,59

Les revenus des prêts de titres sont répartis comme indiqué ci-dessous :

- 65 % au compartiment
- 30 % pour Amundi Intermédiation, Paris, qui est une partie liée.
- 5% pour Caceis Bank, Luxembourg Branch, qui est également une partie liée.

7 COLLATERAL

Au 30 septembre 2022, les garanties reçues ou versées, composées de garanties en espèces reçues de contreparties ou versées à des contreparties dans le cadre d'opérations sur des produits dérivés négociés de gré à gré (CDS, options), étaient les suivantes :

Compartiments	Devise du compartiment	Contrep partie	Type de collateral	Montant du Collateral (en devise du compartiment)
AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE ESG	USD	Morgan Stanley	Cash	340.000,00
		Société Générale, Paris	Cash	24.170.000,00
AMUNDI US TREASURY 7-10	USD	BNP Paribas	Cash	-260.000,00
		BOFA	Cash	16.460.000,00
		JP Morgan	Cash	580.000,00
		Morgan Stanley	Cash	340.000,00

8 CHANGEMENT DANS LA COMPOSITION DE PORTEFEUILLE DE TITRES

Le rapport relatif aux modifications de la composition du portefeuille est disponible gratuitement sur simple demande auprès du siège social du fonds.

9 DIVIDEND PAYÉ

La SICAV a payées ou réinvestie les dividendes suivants par action au cours de l'année :

Compartiments	Classes	Devises	Montant du dividende
AMUNDI CAC 40 ESG	UCITS ETF DR	EUR	1,40
AMUNDI EURO STOXX 50	UCITS ETF DR	EUR	1,24
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE	UCITS ETF DR	EUR	3,45

La date de paiement de tous les dividendes est le 16 novembre 2021.

10 POSITIONS OUVERTES SUR DES CONTRATS DE CHANGE A TERME

Au 30 septembre 2022, les positions ouvertes sur les contrats de change à terme sont les suivants:

■ AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE ESG

Devise d'achat	Achat	Devise de vente	Vente	Maturité	Plus ou (moins)- Value non réalisée (en USD)	Contrepartie
MXN	85.497.100,00	USD	4.217.253,23	04/10/22	34.749,93*	MORGAN STANLEY EUROPE SE (FXO)
EUR	819.668.500,00	USD	822.980.288,61	04/10/22	-19.992.042,58*	Société Générale
EUR	2.499.000,00	USD	2.518.132,34	04/10/22	-69.986,99*	MORGAN STANLEY EUROPE SE (FXO)
MXN	1.137.000,00	USD	56.193,77	04/10/22	352,33*	ROYAL BANK OF CANADA LONDON
EUR	2.615.600,00	USD	2.608.822,98	02/11/22	-41.352,42*	ROYAL BANK OF CANADA LONDON
USD	1.235.639,45	EUR	1.229.700,00	04/10/22	30.963,84*	ROYAL BANK OF CANADA LONDON
USD	6.636.806,78	EUR	6.688.300,00	04/10/22	84.613,68*	ROYAL BANK OF CANADA LONDON
EUR	3.790.200,00	USD	3.776.446,88	04/10/22	-63.377,45*	MORGAN STANLEY EUROPE SE (FXO)
USD	1.503.876,19	MXN	29.867.900,00	04/10/22	18.464,34*	MORGAN STANLEY EUROPE SE (FXO)
USD	2.228.129,86	EUR	2.197.100,00	04/10/22	75.740,84*	MORGAN STANLEY EUROPE SE (FXO)
EUR	10.718.800,00	USD	10.595.266,90	04/10/22	-94.594,48*	MORGAN STANLEY EUROPE SE (FXO)
EUR	1.674.800,00	USD	1.655.479,67	04/10/22	-14.761,85*	CITIGROUP GLOBAL MARKETS
					-20.031.230,81	

■ AMUNDI US TREASURY 7-10

Devise d'achat	Achat	Devise de vente	Vente	Maturité	Plus ou (moins)- Value non réalisée (en USD)	Contrepartie
EUR	411.191.080,40	USD	412.263.220,02	04/10/22	-9.439.878,11*	BOFA SECURITIES EUROPE S.A
USD	14.195.775,35	EUR	14.088.100,00	04/10/22	394.368,18*	HSBC Bank
USD	10.602.633,24	EUR	10.526.400,00	04/10/22	290.445,48*	BNP Paribas. Paris
USD	4.352.711,20	EUR	4.364.000,00	02/11/22	68.876,67*	MORGAN STANLEY EUROPE SE
USD	2.410.644,71	EUR	2.399.100,00	04/10/22	60.366,39*	BOFA SECURITIES EUROPE S.A
USD	2.395.222,92	EUR	2.410.400,00	04/10/22	33.874,56*	MORGAN STANLEY EUROPE SE
EUR	5.234.800,00	USD	5.194.308,30	04/10/22	-66.036,48*	MORGAN STANLEY EUROPE SE
EUR	4.362.300,00	USD	4.328.557,17	04/10/22	-55.029,97*	MORGAN STANLEY EUROPE SE
EUR	4.361.200,00	USD	4.345.374,95	04/10/22	-72.925,37*	MORGAN STANLEY EUROPE SE
EUR	11.553.900,00	USD	11.618.370,76	04/10/22	-299.592,62*	BOFA SECURITIES EUROPE S.A.
EUR	1.769.800,00	USD	1.794.795,42	04/10/22	-61.010,85*	MORGAN STANLEY EUROPE SE
EUR	508.600,00	USD	509.970,88	04/10/22	-11.720,89*	MORGAN STANLEY EUROPE SE
EUR	2.615.400,00	USD	2.652.338,08	04/10/22	-90.161,47*	MORGAN STANLEY EUROPE SE
USD	284.394,56	EUR	284.000,00	04/10/22	6.173,96*	MORGAN STANLEY EUROPE SE
USD	327.828,57	EUR	326.800,00	04/10/22	7.678,95*	MORGAN STANLEY EUROPE SE
EUR	16.550.900,00	USD	16.554.710,02	04/10/22	-340.620,83*	J.P.MORGAN AG
EUR	1.741.900,00	USD	1.710.839,14	04/10/22	-4.386,80*	CITIGROUP GLOBAL MARKETS
USD	29.390.960,32	EUR	30.446.400,00	04/10/22	-435.855,43*	BOFA SECURITIES EUROPE S.A.
USD	4.976.333,66	EUR	5.168.900,00	04/10/22	-87.379,23*	BOFA SECURITIES EUROPE S.A.
USD	15.886.934,04	EUR	16.493.100,00	04/10/22	-270.531,38*	J.P.MORGAN AG
USD	2.549.920,50	EUR	2.609.000,00	04/10/22	-5.986,35*	MORGAN STANLEY EUROPE SE
					-10.379.331,59	

Les contrats marqués par un * concernent spécifiquement la couverture du risque de change.

11 FUTURES

Au 30 septembre 2022, les positions ouvertes sur les contrats de change à terme sont les suivants:

■ AMUNDI CAC 40 ESG

Quantité (Achat/Vente)	Dénomination	Maturité	Devise	Engagement (en EUR) (en valeur absolue)	Non réalisé (en EUR)	Courtier
Futures on index						
5	CAC40 10 EUR	10/2022	EUR	288.117,00	-30.525,00	CACEIS BANK
					-30.525,00	

■ AMUNDI EURO STOXX 50

Quantité (Achat/Vente)	Dénomination	Maturité	Devise	Engagement (en EUR) (en valeur absolue)	Non réalisé (en EUR)	Courtier
Futures on index						
100	DJ EURO STOXX 50	12/2022	EUR	3.318.200,00	-148.150,00	CACEIS BANK
					-148.150,00	

12 FUTURES (suite)**■ AMUNDI DAX 50 ESG**

Quantité (Achat/Vente)	Dénomination	Maturité	Devise	Engagement (en EUR) (en valeur absolue)	Non réalisé (en EUR)	Courtier
Futures on bonds						
3	MICRO DAX	12/2022	EUR	36.343,08	-3.538,50	CACEIS BANK
					-3.538,50	

■ AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG

Quantité (Achat/vente)	Dénomination	Maturité	Devise	Engagement (en EUR) (en valeur absolue)	Non réalisé (en EUR)	Courtier
Futures on index						
66	STOXX EURO E	12/2022	EUR	952.050,00	-85.210,00	CACEIS BANK
					-85.210,00	

■ AMUNDI BBB EURO CORPORATE INVESTMENT GRADE ESG

Quantité (Achat/vente)	Dénomination	Maturité	Devise	Engagement (en EUR) (en valeur absolue)	Non réalisé (en EUR)	Courtier
Futures on bonds						
8	EURO SCHATZ	12/2022	EUR	779.854,64	-7.320,00	CACEIS BANK
3	EURO BOBL FUT	12/2022	EUR	291.000,00	-11.190,00	CACEIS BANK
-1	EURO BUND FU	12/2022	EUR	83.679,00	6.700,00	CACEIS BANK
					-11.810,00	



Rapport d'audit

Aux Actionnaires de
Amundi Index Solutions

Notre opinion

A notre avis, les états financiers ci-joints donnent une image fidèle de la situation financière de Amundi Index Solutions et de chacun de ses compartiments (le « Fonds ») au 30 septembre 2021, ainsi que du résultat de leurs opérations et des variations des actifs nets pour l'exercice clos à cette date, conformément aux prescriptions légales et réglementaires relatives à l'établissement et la présentation des états financiers en vigueur au Luxembourg.

Ce que nous avons audité

Les états financiers du Fonds comprennent :

- l'état du patrimoine au 30 septembre 2022;
- le portefeuille-titres au 30 septembre 2022;
- l'état des opérations et des variations des actifs nets pour l'exercice clos à cette date; et
- les notes aux états financiers – état des instruments dérivés et les autres notes aux états financiers, incluant un résumé des principales méthodes comptables.

Fondement de l'opinion

Nous avons effectué notre audit en conformité avec le EU Regulation No 537/2014, la Loi du 23 juillet 2016 relative à la profession de l'audit (Loi du 23 juillet 2016) et les normes internationales d'audit (ISA) telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF). Les responsabilités qui nous incombent en vertu de la Loi du 23 juillet 2016 et des ISA telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF sont plus amplement décrites dans la section « Responsabilités du Réviseur d'entreprises agréé pour l'audit des états financiers » du présent rapport.

Nous estimons que les éléments probants que nous avons recueillis sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion d'audit.

Nous sommes indépendants du Fonds conformément au code de déontologie des professionnels comptables du conseil des normes internationales de déontologie comptable (le code de l'IESBA) tel qu'adopté pour le Luxembourg par la CSSF ainsi qu'aux règles de déontologie qui s'appliquent à l'audit des états financiers et nous nous sommes acquittés des autres responsabilités qui nous incombent selon ces règles.

Nous déclarons ne pas avoir connaissance d'avoir fourni des services autres que d'audit interdits par l'Article 5(1) du Règlement européen N°537/2014.



Points d'audit majeurs

Les points d'audit majeurs sont ceux qui, selon notre appréciation de professionnels, ont été les plus pertinents dans la révision des états financiers pour la période courante. Ces points ont été traités dans le contexte de notre audit des états financiers dans leur ensemble et dans la formation de notre opinion à cet égard et nous ne formulons pas d'opinion distincte sur ces points.

Points d'audit majeurs	Traitement des points d'audit majeurs dans le cadre de notre audit
<p><i>Évaluation des swaps OTC</i></p> <p>Dans le cadre de leur stratégie d'investissement, certains compartiments d'Amundi Index Solutions utilisent des swaps de gré à gré (OTC) pour reproduire la performance des indices.</p> <p>La valorisation de ces investissements est considérée comme un point d'audit majeur compte tenu du risque potentiel d'anomalie significative.</p> <p>Se reporter à la Note 2 des états financiers concernant la procédure d'évaluation de ces instruments.</p>	<p>Par le biais d'observations, d'examens et de tests, nous avons compris l'environnement de contrôle et l'efficacité opérationnelle des contrôles clés relatifs à la valorisation des swaps OTC (swaps de rendement total) au niveau de l'Agent administratif du Fonds selon le rapport de contrôle ISAE 3402. Par ailleurs, nous avons appréhendé les contrôles clés du processus d'évaluation mis en place par la Société de gestion.</p> <p>Nous avons conduit une évaluation indépendante de tous les swaps de rendement total détenus par le Fonds au 30 septembre 2022.</p> <p>Nous avons établi une fourchette indépendante de valeurs acceptables sur la base de modèles à l'appui de méthodes reconnues, de la prise en compte des conditions principales des contrats et des données de marché observables.</p> <p>Par ailleurs, pour tous les swaps OTC, nous avons comparé la valeur de ces dérivés à la contre-évaluation réalisée par la Société de gestion du Fonds.</p>
<p><i>Existence de swaps OTC</i></p> <p>La valorisation de ces actifs est considérée comme un point d'audit majeur compte tenu du risque potentiel d'anomalie significative combiné au risque inhérent supérieur dont sont assortis les actifs qui ne peuvent pas être détenus par la Banque dépositaire.</p>	<p>Nous avons appréhendé l'environnement de contrôle et l'efficacité opérationnelle des contrôles clés relatifs à l'autorisation, l'exhaustivité et l'exactitude des transactions sur swaps OTC, ainsi que le processus de rapprochement en place pour ces instruments chez l'administrateur du Fonds.</p> <p>Nous avons obtenu de la Banque dépositaire la confirmation de la propriété par le Fonds de tous les instruments swaps OTC. Nous avons validé toutes les positions en vertu de la confirmation par la banque dépositaire par rapport aux registres comptables du Fonds.</p>



Autres informations

La responsabilité des autres informations incombe au Conseil d'Administration du Fonds. Les autres informations se composent des informations présentées dans le rapport annuel mais ne comprennent pas les états financiers et notre rapport d'audit sur ces états financiers.

Notre opinion sur les états financiers ne s'étend pas aux autres informations et nous n'exprimons aucune forme d'assurance sur ces informations.

En ce qui concerne notre audit des états financiers, notre responsabilité consiste à lire les autres informations et, ce faisant, à apprécier s'il existe une incohérence significative entre celles-ci et les états financiers ou la connaissance que nous avons acquise au cours de l'audit, ou encore si les autres informations semblent autrement comporter une anomalie significative. Si, à la lumière des travaux que nous avons effectués, nous concluons à la présence d'une anomalie significative dans les autres informations, nous sommes tenus de signaler ce fait. Nous n'avons rien à signaler à cet égard.

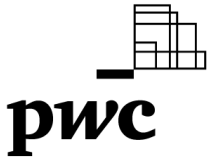
Responsabilités du Conseil d'Administration du Fonds pour les états financiers

Le Conseil d'Administration du Fonds est responsable de l'établissement et de la présentation sincère de ces états financiers, conformément aux prescriptions légales et réglementaires relatives à l'établissement et la présentation des états financiers en vigueur au Luxembourg ainsi que du contrôle interne qu'il considère comme nécessaire pour permettre l'établissement d'états financiers ne comportant pas d'anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs.

Lors de l'établissement des états financiers, c'est au Conseil d'Administration du Fonds qu'il incombe d'évaluer la capacité du Fonds à poursuivre son exploitation, de communiquer, le cas échéant, les questions relatives à la continuité de l'exploitation et d'appliquer le principe comptable de continuité d'exploitation, sauf si le Conseil d'Administration du Fonds a l'intention de liquider le Fonds ou de cesser son activité, ou si aucune autre solution réaliste ne s'offre à lui.

Responsabilités du Réviseur d'entreprises agréé pour l'audit des états financiers

Les objectifs de notre audit sont d'obtenir l'assurance raisonnable que les états financiers pris dans leur ensemble ne comportent pas d'anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs, et de délivrer un rapport d'audit contenant notre opinion. L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, qui ne garantit toutefois pas qu'un audit réalisé conformément à la Loi du 23 juillet 2016 et aux ISA telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF permettra toujours de détecter toute anomalie significative qui pourrait exister. Les anomalies peuvent provenir de fraudes ou résulter d'erreurs et elles sont considérées comme significatives lorsqu'il est raisonnable de s'attendre à ce que, individuellement ou collectivement, elles puissent influencer sur les décisions économiques que les utilisateurs des états financiers prennent en se fondant sur ceux-ci.



Dans le cadre d'un audit réalisé conformément à la Loi du 23 juillet 2016 et aux ISA telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF, nous exerçons notre jugement professionnel et faisons preuve d'esprit critique tout au long de cet audit. En outre:

- nous identifions et évaluons les risques que les états financiers comportent des anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs, concevons et mettons en œuvre des procédures d'audit en réponse à ces risques, et réunissons des éléments probants suffisants et appropriés pour fonder notre opinion. Le risque de non-détection d'une anomalie significative résultant 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 ;
- nous acquérons une compréhension des éléments du contrôle interne pertinents pour l'audit afin de concevoir des procédures d'audit appropriées aux circonstances et non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne du Fonds ;
- nous apprécions le caractère approprié des méthodes comptables retenues et le caractère raisonnable des estimations comptables faites par le Conseil d'Administration du Fonds, de même que les informations y afférentes fournies par ce dernier ;
- nous tirons une conclusion quant au caractère approprié de l'utilisation par le Conseil d'Administration du Fonds du principe comptable de continuité d'exploitation et, selon les éléments probants obtenus, quant à l'existence ou non d'une incertitude significative liée à des événements ou situations susceptibles de jeter un doute important sur la capacité du Fonds à poursuivre son exploitation. Si nous concluons à l'existence d'une incertitude significative, nous sommes tenus d'attirer l'attention des lecteurs de notre rapport sur les informations fournies dans les états financiers au sujet de cette incertitude ou, si ces informations ne sont pas adéquates, d'exprimer une opinion modifiée. Nos conclusions s'appuient sur les éléments probants obtenus jusqu'à la date de notre rapport. Des événements ou situations futurs pourraient par ailleurs amener le Fonds à cesser son exploitation ;
- nous évaluons la présentation d'ensemble, la forme et le contenu des états financiers, y compris les informations fournies dans les notes, et apprécions si les états financiers représentent les opérations et événements sous-jacents d'une manière propre à donner une image fidèle.

Nous communiquons aux responsables du gouvernement d'entreprise notamment l'étendue et le calendrier prévu des travaux d'audit et nos constatations importantes, y compris toute déficience importante du contrôle interne que nous aurions relevée au cours de notre audit.

Nous fournissons également aux entités en charge de la gouvernance une déclaration selon laquelle nous nous conformons aux règles éthiques en vigueur en matière d'indépendance et nous leur faisons part de l'ensemble des relations et autres points à mettre en avant raisonnablement par rapport à notre indépendance, ainsi que les actions conduites, le cas échéant, pour éliminer les menaces ou accroître la sécurité.

Par rapport aux points communiqués à ceux en charge de la gouvernance, nous déterminons ceux qui ont été les plus significatifs dans l'audit des états financiers de la période considérée et qui constituent



donc les points d'audit majeurs. Nous décrivons ces points dans notre rapport d'audit sauf s'il est interdit par la loi ou la réglementation en vigueur de les divulguer.

Rapport sur les autres obligations légales et réglementaires

Nous avons été nommés Réviseur d'entreprises agréé du Fonds par l'assemblée générale des actionnaires tenue le 28 janvier 2022 et la durée de notre engagement ininterrompu, y compris les renouvellements ou reconductions antérieurs, est de deux ans.

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative
Représenté par

Luxembourg, 31 Janvier 2023

Thomas Druant

SECURITIES FINANCING TRANSACTIONS AND OF REUSE REGULATION (« SFTR »)

1 OPÉRATIONS DE PRÊT DE TITRES

Le règlement relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation (Securities Financing Transactions Regulation ou SFTR) est entré en vigueur le 12 janvier 2016 afin d'améliorer la transparence dans les prêts de titres et de produits de base, les opérations de mise en pension, les prêts sur marge et certains contrats de garantie. Les exigences de divulgation du SFTR comprennent les détails suivants sur le prêt de titres :

OPÉRATIONS DE PRÊT DE TITRES	AMUNDI CAC 40 ESG	AMUNDI EURO STOXX 50	AMUNDI DAX 50 ESG	AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG	AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB
Actifs utilisés					
En termes absolus	129.762.247,29	378.349.030,37	1.997.324,89	22.630.551,56	272.928.681,26
En % des actifs prêtables	16,47	22,55	16,05	15,64	16,10
En % de la Valeur Nette d'Inventaire totale	16,47	22,52	16,01	15,54	16,04
Opérations classées en fonction de leur maturité résiduelle					
Moins de 1 jour	-	-	-	-	-
De 1 jour à 1 semaine	-	-	-	982.694,46	9.103.368,58
De 1 semaine à 1 mois	-	-	-	102.534,00	1.561.212,52
De 1 mois à 3 mois	-	-	-	-	3.291.000,00
De 3 mois à 1 an	-	26.480.750,20	-	-	-
Plus d'1 an	-	-	-	-	-
Échéance ouverte	129.762.247,29	351.868.280,17	1.997.324,89	21.545.323,10	258.973.100,16
Devise:	<i>En Eur</i>	<i>en Eur</i>	<i>En Eur</i>	<i>En Eur</i>	<i>En Eur</i>
Les contreparties					
1er nom	SOCIETE GENERALE	HSBC France	SOCIETE GENERALE	SOCIETE GENERALE	SOCIETE GENERALE
Volumes bruts des opérations en cours	95.794.510,71	114.023.789,65	1.085.813,20	17.158.712,80	212.961.162,27
1er pays de domicile	France	France	France	France	France
2ème nom	HSBC France	SOCIETE GENERALE	BOFA EUROPE	BOFA EUROPE	BOFA EUROPE
Volumes bruts des opérations en cours	15.305.117,50	74.370.428,29	508.354,74	3.794.995,59	49.702.524,48
2ème pays de domicile	France	France	Royaume-Unis	Royaume-Unis	Royaume-Unis
3ème nom	BOFA EUROPE	MORGAN STANLEY ESE PE	CALYON	CITIGROUP GLOBAL MARKETS EUROPE AG	CALYON
Volumes bruts des opérations en cours	6.286.029,40	49.800.202,55	248.920,00	868.446,11	6.309.000,00
3ème pays de domicile	Royaume-Unis	Etats-Unis	France	Royaume-Unis	France
4ème nom	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	CITIGROUP GLOBAL MARKETS EUROPE AG	CALYON	CITIGROUP GLOBAL MARKETS EUROPE AG
Volumes bruts des opérations en cours	4.670.694,41	29.523.103,26	154.236,95	466.725,00	3.706.530,29
4ème pays de domicile	France	France	Royaume-Unis	France	Royaume-Unis
5ème nom	JP MORGAN	CALYON		IXIS CIB	IXIS CIB
Volumes bruts des opérations en cours	3.825.596,19	24.135.312,80		341.672,06	249.464,22
5ème pays de domicile	Etats-Unis	France		France	France
6ème nom	MORGAN STANLEY ESE PE	CITIGROUP GLOBAL MARKETS EUROPE AG			
Volumes bruts des opérations en cours	3.598.641,65	20.447.874,03			
6ème pays de domicile	Etats-Unis	Royaume-Unis			

1 OPÉRATIONS DE PRÊT DE TITRES (suite)

OPÉRATIONS DE PRÊT DE TITRES	AMUNDI CAC 40 ESG	AMUNDI EURO STOXX 50	AMUNDI DAX 50 ESG	AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG	AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB
7ème nom Volumes bruts des opérations en cours 7ème pays de domicile	BARCLAYS BANK IRELAND 281.657,42 Irlande	BOFA EUROPE 18.465.559,38 Royaume-Unis			
8ème nom Volumes bruts des opérations en cours 8ème pays de domicile		IXIS CIB 15.942.786,52 France			
9ème nom Volumes bruts des opérations en cours 9ème pays de domicile		GOLDMAN SACHS BANK EUROPE SE 10.377.719,67 France			
10ème nom Volumes bruts des opérations en cours 10ème pays de domicile		BCO SANTANDER 10.377.115,53 Espagne			
11ème nom Volumes bruts des opérations en cours 11ème pays de domicile		JP MORGAN 5.814.022,32 Etats-Unis			
12ème nom Volumes bruts des opérations en cours 12ème pays de domicile		UNICREDIT 5.071.116,40 Italie			
Transaction par pays :	France 115.770.322,62 Royaume-Unis 6.286.029,40 United States 7.424.237,84 Irlande 281.657,42 France 115.770.322,62	France 268.373.140,18 Etats-Unis 55.614.224,86 Royaume-Unis 38.913.433,40 Espagne 10.377.115,53 Italie 5.071.116,40	France 1.334.733,20 Royaume-Unis 662.591,69	France 17.967.109,86 Royaume-Unis 4.663.441,70	France 219.519.626,49 Royaume-Unis 53.409.054,77
Transaction par règlement :					
- bipartite	129.762.247,29	365.960.214,85	1.997.324,89	22.630.551,56	272.928.681,26
- tripartite	-	12.388.815,53	-	-	-
Garantie reçue Type: Liquidités	135.089.473,21	198.519.500,00	2.040.335,00	23.098.724,12	278.414.391,79
Obligations et actions	-	188.004.030,40	-	-	-
Total des garanties reçues	135.089.473,21	386.523.530,40	2.040.335,00	23.098.724,12	278.414.391,79

1 OPÉRATIONS DE PRÊT DE TITRES (suite)

OPÉRATIONS DE PRÊT DE TITRES	AMUNDI CAC 40 ESG	AMUNDI EURO STOXX 50	AMUNDI DAX 50 ESG	AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG	AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB
Qualité (notation des émetteurs de garantie obligataire) :	NA	A- to BBB+	NA	NA	NA
Devise	<i>en Eur</i>	<i>en Eur</i>	<i>en Eur</i>	<i>en Eur</i>	<i>en Eur</i>
Classification selon les échéances résiduelles					
Moins de 1 jour	-	-	-	-	-
De 1 jour à 1 semaine	-	-	-	-	-
De 1 semaine à 1 mois	-	-	-	-	-
De 1 mois à 3 mois	-	-	-	-	-
De 3 mois à 1 an	-	-	-	-	-
Plus d'1 an	-	11.719.190,56	-	-	-
Échéance ouverte	-	176.284.839,84	-	-	-
Les 10 principaux émetteurs de garanties reçues					
1er nom		CELLNEX TELECOM			
Montant		82.704.555,09			
2ème nom		FERROVIAL SA			
Montant		21.676.266,80			
3ème nom		FERROVIAL SA			
Montant		19.552.930,18			
4ème nom		CREDIT AGRICOLE			
Montant		12.402.108,45			
5ème nom		EDF			
Montant		11.217.054,66			
6ème nom		FRAN GOV 1,5 05-31			
Montant		10.532.434,91			
7ème nom		CELLNEX TELECOM			
Montant		6.803.810,54			
8ème nom		UNIT ST 1,125 01-25			
Montant		2.067.308,43			
9ème nom		BELGIQUE 5 35 OLO			
Montant		1.858.847,16			
10ème nom		LEGRAND SA			
Montant		1.853.337,06			
Composants des revenus					
<i>Composant des revenus du fonds :</i>					
En montant absolu	162.619,03	523.122,39	759,34	11.539,16	112.667,79
En % des revenus bruts	65%	65%	65%	65%	65%
<i>Composante de revenus de</i>					
Amundi					
Intermediation	75.180,93	241.435,80	350,67	5.325,72	51.993,81
Caceis Bank					
Luxembourg, Branch	12.530,16	40.239,30	58,45	887,62	8.665,63
En montant absolu	87.711,09	281.675,10	409,12	6.213,34	60.659,44
En % des revenus bruts	35%	35%	35%	35%	35%

1 OPÉRATIONS DE PRÊT DE TITRES (suite)

Le compartiment suivant a dégagé des revenus sur prêt de titres au cours de l'exercice clos le 30 septembre 2022 et n'a pas conduit d'activité de prêt :

OPÉRATIONS DE PRÊT DE TITRES	AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX
Composants des revenus	
<i>Composant des revenus du fonds :</i>	
En montant absolu	10.152,32
En % des revenus bruts	65%
<i>Composante de revenus de</i>	
Amundi Intermediation	4.685,68
Caceis Bank Luxembourg, Branch	780,95
En montant absolu	5.466,63
En % des revenus bruts	35%

2 EQUITIES SWAP

Swap	AMUNDI JAPAN TOPIX	AMUNDI JPX NIKKEI 400	AMUNDI MSCI CHINA	AMUNDI MSCI EASTERN EUROPE EX RUSSIA
Actifs utilisés				
En % des actifs du fonds	2.098.672,81	491.030,32	363.428,46	9.301,45
Notional	0,23	0,21	0,48	0,06
En % des actifs du fonds	1.834.906.582,84	499.068.052,38	83.485.926,92	18.014.319,34
Actifs utilisés	204,38	210,66	111,26	107,29
Opérations classées en fonction de leur maturité résiduelle				
Moins de 1 jour	-	-	-	-
De 1 jour à 1 semaine	-	-	-	-
De 1 semaine à 1 mois	-	-	-	-
De 1 mois à 3 mois	1.834.906.582,84	499.068.052,38	83.485.926,92	18.014.319,34
De 3 mois à 1 an	-	-	-	-
Plus d'1 an	-	-	-	-
Échéance ouverte	-	-	-	-
Contreparties par ordre décroissant				
1er nom	BNP-PARIBAS SA PARIS	BNP-PARIBAS SA PARIS	BNP-PARIBAS SA PARIS	BNP-PARIBAS SA PARIS
Volumes bruts des opérations en cours	1.834.906.582,84	499.068.052,38	83.485.926,92	18.014.319,34
1er pays de domicile	France	France	France	France
Transaction par pays	France	France	France	France
	1.834.906.582,84	499.068.052,38	83.485.926,92	18.014.319,34
Transaction par règlement :				
- bipartite	1.834.906.582,84	499.068.052,38	83.485.926,92	18.014.319,34
- tripartite	-	-	-	-

2 EQUITIES SWAP (suite)

Swap	AMUNDI MSCI EM ASIA	AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA	AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS	AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND
Actifs utilisés				
En % des actifs du fonds	30.926.253,24	3.230.105,14	39.279.970,84	3.594.383,47
Notional	1,67	1,21	1,41	1,79
En % des actifs du fonds	1.881.849.703,37	272.273.915,84	2.789.362.836,20	200.999.476,40
Actifs utilisés	101,85	102,06	100,02	100,11
Opérations classées en fonction de leur maturité résiduelle				
Moins de 1 jour	-	-	-	-
De 1 jour à 1 semaine	-	-	-	-
De 1 semaine à 1 mois	-	-	-	-
De 1 mois à 3 mois	1.881.849.703,37	272.273.915,84	2.789.362.836,20	200.999.476,40
De 3 mois à 1 an	-	-	-	-
Plus d'1 an	-	-	-	-
Échéance ouverte	-	-	-	-
Contreparties par ordre décroissant				
1er nom	BNP-PARIBAS SA PARIS	BNP-PARIBAS SA PARIS	BNP-PARIBAS SA PARIS	BNP-PARIBAS SA PARIS
Volumes bruts des opérations en cours	1.881.849.703,37	272.273.915,84	2.789.362.836,20	200.999.476,40
1er pays de domicile	France	France	France	France
Transaction par pays	France	France	France	France
	1.881.849.703,37	272.273.915,84	2.789.362.836,20	200.999.476,40
Transaction par règlement :				
- bipartite	1.881.849.703,37	272.273.915,84	2.789.362.836,20	200.999.476,40
- tripartite	-	-	-	-

2 EQUITIES SWAP (suite)

Swap	AMUNDI MSCI INDIA	AMUNDI MSCI NORDIC	AMUNDI MSCI SWITZERLAND	AMUNDI MSCI USA
Actifs utilisés				
En % des actifs du fonds	2.356.382,43	2.378.227,13	3.489.754,01	14.311.753,92
Notional	1,67	1,36	0,58	1,88
En % des actifs du fonds	146.345.392,26	176.554.346,02	600.601.601,34	775.078.879,17
Actifs utilisés	103,74	100,64	100,31	101,80
Opérations classées en fonction de leur maturité résiduelle				
Moins de 1 jour	-	-	-	-
De 1 jour à 1 semaine	-	-	-	-
De 1 semaine à 1 mois	-	-	-	-
De 1 mois à 3 mois	146.345.392,26	176.554.346,02	600.601.601,34	775.078.879,17
De 3 mois à 1 an	-	-	-	-
Plus d'1 an	-	-	-	-
Échéance ouverte	-	-	-	-
Contreparties par ordre décroissant				
1er nom	BNP-PARIBAS SA PARIS	BNP-PARIBAS SA PARIS	BNP-PARIBAS SA PARIS	BNP-PARIBAS SA PARIS
Volumes bruts des opérations en cours	146.345.392,26	176.554.346,02	600.601.601,34	775.078.879,17
1er pays de domicile		France	France	France
Transaction par pays	France	France	France	France
	France	176.554.346,02	600.601.601,34	775.078.879,17
Transaction par règlement :	146.345.392,26			
- bipartite		176.554.346,02	600.601.601,34	775.078.879,17
- tripartite	-	-	-	-

2 EQUITIES SWAP (suite)

Swap	AMUNDI MSCI WORLD	AMUNDI MSCI WORLD ENERGY	AMUNDI RUSSELL 2000	AMUNDI S&P 500
Actifs utilisés				
En % des actifs du fonds	48.347.199,12	419.454,16	2.003.502,68	62.596.119,57
Notional	12,02	0,33	1,42	0,99
En % des actifs du fonds	446.848.453,20	136.015.593,38	150.307.039,49	12.975.626.623,40
Actifs utilisés	111,06	108,12	106,48	204,91
Opérations classées en fonction de leur maturité résiduelle				
Moins de 1 jour	-	-	-	-
De 1 jour à 1 semaine	-	-	-	-
De 1 semaine à 1 mois	-	-	-	-
De 1 mois à 3 mois	446.848.453,20	136.015.593,38	150.307.039,49	12.975.626.623,40
De 3 mois à 1 an	-	-	-	-
Plus d'1 an	-	-	-	-
Échéance ouverte	-	-	-	-
Contreparties par ordre décroissant				
1er nom	BNP-PARIBAS SA PARIS	BNP-PARIBAS SA PARIS	BNP-PARIBAS SA PARIS	BNP-PARIBAS SA PARIS
Volumes bruts des opérations en cours	446.848.453,20	136.015.593,38	150.307.039,49	12.975.626.623,40
1er pays de domicile	France	France	France	France
Transaction par pays	France	France	France	France
	446.848.453,20	136.015.593,38	150.307.039,49	12.975.626.623,40
Transaction par règlement :				
- bipartite	446.848.453,20	136.015.593,38	150.307.039,49	12.975.626.623,40
- tripartite	-	-	-	-

2 EQUITIES SWAP (suite)

Swap	AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY	AMUNDI SMART CITY	AMUNDI SMART FACTORY	AMUNDI STOXX GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE
Actifs utilisés				
En % des actifs du fonds	4.757.196,29	60.691,51	7.313,90	293.542,60
Notional	1,45	0,43	0,03	0,09
En % des actifs du fonds	373.019.330,54	15.109.860,35	35.004.932,63	346.383.167,86
Actifs utilisés	113,88	107,24	122,69	103,35
Opérations classées en fonction de leur maturité résiduelle				
Moins de 1 jour	-	-	-	-
De 1 jour à 1 semaine	-	-	-	-
De 1 semaine à 1 mois	-	-	-	-
De 1 mois à 3 mois	373.019.330,54	15.109.860,35	35.004.932,63	346.383.167,86
De 3 mois à 1 an	-	-	-	-
Plus d'1 an	-	-	-	-
Échéance ouverte	-	-	-	-
Contreparties par ordre décroissant				
1er nom	BNP-PARIBAS SA PARIS	BNP-PARIBAS SA PARIS	BNP-PARIBAS SA PARIS	BNP-PARIBAS SA PARIS
Volumes bruts des opérations en cours	373.019.330,54	15.109.860,35	35.004.932,63	346.383.167,86
1er pays de domicile	France	France	France	France
Transaction par pays	France	France	France	France
	373.019.330,54	15.109.860,35	35.004.932,63	346.383.167,86
Transaction par règlement :				
- bipartite	373.019.330,54	15.109.860,35	35.004.932,63	346.383.167,86
- tripartite	-	-	-	-

Composants des revenus et des dépenses : il n'y a pas d'accord de partage des frais sur les swaps et 100 % des coûts/rendements générés sont comptabilisés dans l'état des opérations et des variations de l'actif net de la Société.

POLITIQUE ET PRATIQUES DE RÉMUNÉRATION

La politique de rémunération d'Amundi Luxembourg est conforme aux obligations détaillées dans la Directive européenne 2014/91/UE entrée en vigueur le 18 mars 2016 et transposée dans la loi luxembourgeoise le 10 mai 2016.

Elle se fonde sur le cadre de rémunération à l'échelle du groupe Amundi et est revue chaque année par le Comité des rémunérations du groupe Amundi avant d'être approuvée par le Conseil d'Amundi Luxembourg.

Cette politique fait l'objet d'un examen indépendant de la fonction Conformité interne. En 2021, aucun changement matériel n'est intervenu dans la politique de rémunération adoptée les années précédentes. La politique applicable en 2021 a été approuvée par le Conseil d'Amundi Luxembourg le 15 avril 2021 et examinée par le Comité des rémunérations du groupe Amundi le 9 février 2021.

Les objectifs de la politique et les pratiques en matière de rémunération s'inscrivent dans une volonté de gestion efficace des risques qu'ils préconisent et alignent la rémunération sur la performance à long terme et les risques en vue d'éviter les conflits d'intérêts. Les composantes de la rémunération fixe sont liées aux fonctions concernées, aux services professionnels rendus et au périmètre de responsabilité. Elles tiennent compte du niveau de qualification, des niveaux de salaires sur le marché, de l'expérience et des compétences requises pour chacun poste, ainsi que du niveau d'excellence démontré. La rémunération variable est destinée à promouvoir le développement durable à long terme de la Société de gestion et un système de gestion des risques solide et efficace. La rémunération variable tient compte de la performance du salarié, du département au sein duquel il travaille et du groupe Amundi dans son ensemble. Elle se fonde à la fois sur des critères financiers et autres.

Amundi Luxembourg et le groupe Amundi ont défini l'ensemble des personnels identifiés ayant autorité ou exerçant une influence sur les fonds gérés par Amundi et qui sont donc susceptibles d'avoir un impact sur la performance ou le profil de risque de nos fonds.

1. MONTANTS DE RÉMUNÉRATION ACCORDÉS

Au 31 décembre 2021, Amundi Luxembourg, Société de gestion, agit en qualité de Société de gestion ou d'AIFM pour plusieurs compartiments et OPCVM et AIF indépendants.

La rémunération totale payée par Amundi Luxembourg à son personnel au titre de l'exercice 2021 est la suivante :

	Nbre de bénéficiaires	Part fixe	Part variable	Total
Effectif	82	7,662,788	1,192,475	8,855,263
Dont				
Personnel identifié	9	1,479,885	494,995	1,974,880
Autres personnels	73	6,182,903	697,480	6,880,383

Au 31/12/2021, Amundi Index Solutions représentait environ 46% et au 30/09/2022, environ 44% du total de l'actif net sous gestion d'Amundi Luxembourg S.A. Les éléments de rémunération indiqués ci-dessus se rapportent aux activités relatives à l'ensemble des fonds gérés.

Les salariés d'Amundi Luxembourg S.A. et du groupe Amundi qui ont été nommés au Conseil d'administration de la Société de Gestion et du Fonds renoncent à toute rémunération pour l'ensemble des fonds gérés.

Aucun employé de la Société de gestion ne perçoit de montants, notamment sous forme de parts d'intéressement et de commissions de performance, qui seraient versés directement par les OPCVM ou les FIA gérés.

2. RÉMUNÉRATION DES DÉLÉGUÉS

Au 30 septembre 2022 :

- Amundi Asset Management gère 940,91 milliards d'EUR d'actifs sous gestion, dont 84,41 milliards d'EUR représentés par des compartiments de la structure à compartiments multiples (respectivement 8,97 % du total des actifs gérés par le Gestionnaire d'investissement et 96,42 % du total des actifs sous gestion de la structure à compartiments multiples). La part proportionnelle de la rémunération totale du personnel identifié attribuable à la gestion de ces compartiments s'élevait à 3,215,254 EUR, dont 1,263,366 EUR en rémunération fixe et 1,951,888 EUR en rémunération variable. La part proportionnelle de la rémunération totale du personnel attribuable à la gestion de ces compartiments s'élevait à 15,118,594 EUR, dont 9,972,441 EUR en rémunération fixe et 5,146,153 EUR en rémunération variable. Amundi Asset Management comptait 69 membres du personnel identifié sur un total de 1.400 collaborateurs en 2021.

- Amundi Japan Ltd gère 25,49 milliards d'EUR d'actifs sous gestion, dont 3,13 milliard d'EUR représentés par des compartiments de la structure à compartiments multiples (respectivement 12,28 % du total des actifs gérés par le Gestionnaire d'investissement et 3,58 % du total des actifs sous gestion de la structure à compartiments multiples). La part proportionnelle de la rémunération totale du personnel identifié attribuable à la gestion de ces compartiments s'élevait à 402,706 EUR, dont 285,071 EUR en rémunération fixe et 117.635 EUR en rémunération variable. La part proportionnelle de la rémunération totale du personnel attribuable à la gestion de ces compartiments s'élevait à 2,425,261 EUR, dont 1,928,336 EUR en rémunération fixe et 496,925 EUR en rémunération variable. Amundi Japan Ltd comptait 12 collaborateurs identifiés sur un total de 160 en 2021.

Il est précisé que les derniers chiffres communiqués concernant les rémunérations se rapportent à l'année civile 2021.

METHODE DE CALCUL DE L'EXPOSITION GLOBALE

L'APPROCHE PAR LES ENGAGEMENTS

Les compartiments suivants utilisent l'approche par les engagements pour contrôler et mesurer leur exposition globale :

AMUNDI CAC 40 ESG
 AMUNDI EURO STOXX 50
 AMUNDI JAPAN TOPIX
 AMUNDI JPX-NIKKEI 400
 AMUNDI MSCI BRAZIL
 AMUNDI MSCI CHINA
 AMUNDI MSCI EASTERN EUROPE EX RUSSIA
 AMUNDI MSCI EM ASIA
 AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA
 AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS
 AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND
 AMUNDI MSCI INDIA
 AMUNDI MSCI NORDIC
 AMUNDI MSCI SWITZERLAND
 AMUNDI MSCI USA
 AMUNDI MSCI WORLD
 AMUNDI MSCI WORLD ENERGY
 AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE
 AMUNDI MSCI WORLD FINANCIALS
 AMUNDI RUSSELL 2000
 AMUNDI S&P 500
 AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY
 AMUNDI SMART CITY
 AMUNDI SMART FACTORY
 AMUNDI STOXX GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE
 AMUNDI DAX 50 ESG
 AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG
 AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB
 AMUNDI BBB EURO CORPORATE INVESTMENT GRADE
 AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE ESG
 AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX
 AMUNDI GOVT BOND EUROMTS BROAD INVESTMENT GRADE
 AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EUROMTS INVESTMENT GRADE
 AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EUROMTS INVESTMENT GRADE 1-3
 AMUNDI US TREASURY 1-3
 AMUNDI US TREASURY 3-7
 AMUNDI US TREASURY 7-10

■ **REPRESENTANT :**

CACEIS (Switzerland) SA, Route de Signy 35, CH-1260 Nyon exerce les fonctions de représentant du Fonds en Suisse (le « Représentant »).

■ **SERVICE DE PAIEMENT :**

CACEIS Bank, Montrouge, succursale de Nyon / Suisse, Route de Signy 35, CH-1260 Nyon, assure le service de paiement pour le compte du Fonds en Suisse.

■ **LIEU DE DISTRIBUTION DES DOCUMENTS DETERMINANTS :**

Le prospectus, les feuilles d'information de base, le règlement, la liste des achats et des ventes ainsi que les rapports annuels et semestriels du Fonds peuvent être obtenus gratuitement auprès du Représentant.

■ **LIEU D'EXECUTION ET FOR :**

Pour les actions proposées en Suisse, le lieu d'exécution se situe au siège du représentant. Le for judiciaire est au siège du représentant, ou au siège ou au lieu de domicile de l'investisseur.

1 TOTAL EXPENSE RATIO

Le Total Expense Ratio (TER) est l'indice exprimant l'ensemble des charges d'exploitation imputables au fonds en un pourcentage des actifs nets moyens de ce fonds. Pour la période considérée, le Total Expense Ratio annualisé est le suivant :

Nom du compartiment	Nom de la classe	TER sans performance	TER avec performance
AMUNDI CAC 40 ESG	Classe UCITS ETF DR EUR de capitalisation	0,23	0,23
	Classe UCITS ETF DR EUR de distribution	0,22	0,22
AMUNDI EURO STOXX 50	Classe UCITS ETF DR EUR de capitalisation	0,13	0,13
	Classe UCITS ETF DR EUR de distribution	0,12	0,12
	Classe UCITS ETF DR USD de capitalisation	0,12	0,12
AMUNDI JAPAN TOPIX	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED CHF de capitalisation	0,48	0,48
	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED EUR de capitalisation	0,48	0,48
	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED GBP de capitalisation	0,48	0,48
	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED USD de capitalisation	0,48	0,48
	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,20	0,20
	Classe UCITS ETF JPY de capitalisation	0,20	0,20
AMUNDI JPX NIKKEI 400	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED CHF de capitalisation	0,18	0,18
	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED EUR de capitalisation	0,18	0,18
	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED GBP de capitalisation	0,18	0,18
	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED USD de capitalisation	0,18	0,18
	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,18	0,18
	Classe UCITS ETF JPY de capitalisation	0,18	0,18
AMUNDI MSCI BRAZIL	Classe UCITS ETF de capitalisation	0,55	0,55
AMUNDI MSCI CHINA	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,55	0,55
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	0,55	0,55
AMUNDI MSCI EASTERN EUROPE EX RUSSIA	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,20	0,20
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	0,20	0,20
AMUNDI MSCI EM ASIA	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,20	0,20
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	0,20	0,20
AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,20	0,20
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	0,20	0,20
AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,20	0,20
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	0,20	0,20
AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,20	0,20
AMUNDI MSCI INDIA	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,80	0,80
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	0,80	0,80

1 TOTAL EXPENSE RATIO (suite)

Nom du compartiment	Nom de la classe	TER sans performance	TER avec performance
AMUNDI MSCI NORDIC	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,25	0,25
AMUNDI MSCI SWITZERLAND	Classe UCITS ETF CHF de capitalisation	0,25	0,25
	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,25	0,25
AMUNDI MSCI USA	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,28	0,28
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	0,28	0,28
AMUNDI MSCI WORLD	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,38	0,38
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	0,38	0,38
AMUNDI MSCI WORLD ENERGY	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,35	0,35
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	0,35	0,35
AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,35	0,35
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	0,35	0,35
AMUNDI MSCI WORLD FINANCIALS	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,35	0,35
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	0,35	0,35
AMUNDI RUSSELL 2000	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,35	0,35
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	0,35	0,35
AMUNDI S&P 500	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED EUR de capitalisation	0,28	0,28
	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,15	0,15
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	0,15	0,15
	Classe UCITS ETF USD de distribution	0,14	0,14
AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,25	0,25
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	0,25	0,25
AMUNDI SMART CITY	Class UCITS ETF de capitalisation	0,35	0,35
AMUNDI SMART FACTORY	Class UCITS ETF de capitalisation	0,35	0,35
AMUNDI STOXX GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE	Classe UCITS ETF de capitalisation	0,35	0,35
AMUNDI DAX 50 ESG	Classe UCITS ETF DR de capitalisation	0,16	0,16
AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,17	0,17
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB	Classe I14E de capitalisation	n/a	n/a
	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	0,15	0,15
AMUNDI BBB EURO CORPORATE INVESTMENT GRADE	Classe UCITS ETF DR EUR de capitalisation	0,18	0,18
AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE	Classe UCITS ETF HEDGED EUR de capitalisation	0,18	0,18
	Classe UCITS ETF HEDGED MXN de capitalisation	0,12	0,12
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	0,16	0,16
AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKET IBOXX	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	0,28	0,28
AMUNDI GOVT BOND EUROMTS BROAD INVESTMENT GRADE	Classe UCITS ETF DR EUR de capitalisation	0,12	0,12
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EUROMTS INVESTMENT GRADE	Classe UCITS ETF DR EUR de capitalisation	0,12	0,12
	Classe UCITS ETF DR EUR de distribution	0,12	0,12
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EUROMTS INVESTMENT GRADE 1-3	Classe UCITS ETF DR EUR de capitalisation	0,12	0,12
AMUNDI US TREASURY 1-3	Classe UCITS ETF DR USD de capitalisation	0,13	0,13
AMUNDI US TREASURY 3-7	Classe UCITS ETF DR USD de capitalisation	0,13	0,13
AMUNDI US TREASURY 7-10	Classe UCITS ETF DR - HEDGED EUR de capitalisation	n/a	n/a
	Classe UCITS ETF DR USD de capitalisation	0,14	0,14

2 CHANGEMENT DANS LE NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION

Nom du compartiment	Nom de la classe	Actions en circulation au 01/10/21	Actions souscrites	Actions rachetées	Actions en circulation au 30/09/22
AMUNDI CAC 40 ESG	Classe UCITS ETF DR EUR de capitalisation	10.189.873,00	748.409,00	3.948.556,00	6.992.726,00
	Classe UCITS ETF DR EUR de distribution	3.189.718,00	956.314,00	1.354.798,00	2.791.234,00
AMUNDI EURO STOXX 50	Classe UCITS ETF DR EUR de capitalisation	23.233.658,00	4.290.296,37	7.736.837,10	19.787.117,28
	Classe UCITS ETF DR EUR de distribution	1.470.047,00	2.543.956,00	2.205.022,00	1.808.981,00
	Classe UCITS ETF DR USD de capitalisation	231.594,00	10.030,00	114.670,00	126.954,00
AMUNDI JAPAN TOPIX	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED CHF de capitalisation	41.520,00	89.557,00	88.300,00	42.777,00
	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED EUR de capitalisation	1.967.538,00	445.589,00	819.502,00	1.593.625,00
	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED GBP de capitalisation	22.273,00	84.129,00	17.800,00	88.602,00
	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED USD de capitalisation	195.853,00	139.025,00	14.400,00	320.478,00
	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	3.116.479,00	2.607.198,00	1.538.358,00	4.185.319,00
	Classe UCITS ETF JPY de capitalisation	2.156.354,00	682.867,00	1.211.722,00	1.627.499,00
AMUNDI JPX-NIKKEI 400	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED CHF de capitalisation	61.995,00	40.605,00	25.700,00	76.900,00
	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED EUR de capitalisation	560.710,00	366.631,00	294.979,00	632.362,00
	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED GBP de capitalisation	5.933,00	4.650,00	4.235,00	6.348,00
	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED USD de capitalisation	173.984,00	-	7.435,00	166.549,00
	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	368.317,00	63.425,00	52.040,00	379.702,00
	Classe UCITS ETF JPY de capitalisation	412.975,00	44.370,00	235.110,00	222.235,00
AMUNDI MSCI BRAZIL	Classe UCITS ETF de capitalisation	158.247,00	-	-	158.247,00
AMUNDI MSCI CHINA	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	242.585,00	162.715,00	115.924,00	289.376,00
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	37.976,00	-	20.305,00	17.671,00
AMUNDI MSCI EASTERN EUROPE EX RUSSIA	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	92.359,00	71.132,00	90.341,00	73.150,00
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	15.578,00	14.600,00	10.530,00	19.648,00
AMUNDI MSCI EM ASIA	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	38.173.874,00	9.085.363,00	10.690.873,00	36.568.364,00
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	29.157.075,00	4.536.531,00	10.126.991,00	23.566.615,00

2 CHANGEMENT DANS LE NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION (suite)

Nom du compartiment	Nom de la classe	Actions en circulation au 01/10/21	Actions souscrites	Actions rachetées	Actions en circulation au 30/09/22
AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	14.475.610,00	15.025.419,00	13.569.264,00	15.932.765,00
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	4.298.509,00	1.612.534,00	2.237.009,00	3.674.034,00
AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	513.912.009,00	34.000.081,00	92.755.013,00	455.268.077,00
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	248.570.168,00	24.984.255,00	73.519.076,00	200.035.347,00
AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND	Classe UCITS ETF de capitalisation	638.880,00	358.056,00	111.000,00	885.936,00
AMUNDI MSCI INDIA	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	137.959,00	25.623,00	27.741,00	135.841,00
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	108.232,00	17.760,00	80.397,00	45.595,00
AMUNDI MSCI NORDIC	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	511.932,00	50.790,00	192.629,00	370.093,00
AMUNDI MSCI SWITZERLAND	Classe UCITS ETF CHF de capitalisation	283.538,00	1.023.288,00	98.469,00	1.208.357,00
	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	335.195,00	385.367,00	316.586,00	403.976,00
AMUNDI MSCI USA	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	2.054.132,00	808.769,00	1.850.434,00	1.012.467,00
	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	609.329,00	104.067,00	87.419,00	625.977,00
AMUNDI MSCI WORLD	Classe UCITS ETF EUR of capitalisation	4.479.212,00	1.214.564,00	346.439,00	5.347.337,00
	Classe UCITS ETF USD of capitalisation	34.294,00	97.662,00	75.361,00	56.595,00
AMUNDI MSCI WORLD ENERGY	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	379.758,00	113.922,00	275.286,00	218.394,00
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	8.232,00	87.973,00	63.872,00	32.333,00
AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	904.965,00	114.681,00	54.716,00	964.930,00
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	2.630,00	14.025,00	13.920,00	2.735,00
AMUNDI MSCI WORLD FINANCIALS	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	812.101,00	200.238,00	459.114,00	553.225,00
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	68.889,00	26.429,00	8.600,00	86.718,00
AMUNDI RUSSELL 2000	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	479.604,00	146.439,00	215.827,00	410.216,00
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	216.533,00	38.943,00	90.854,00	164.622,00

2 CHANGEMENT DANS LE NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION (suite)

Nom du compartiment	Nom de la classe	Actions en circulation au 01/10/21	Actions souscrites	Actions rachetées	Actions en circulation au 30/09/22
AMUNDI S&P 500	Classe UCITS ETF DAILY HEDGED EUR de capitalisation	10.379.812,00	2.227.985,00	4.205.799,00	8.401.998,00
	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	42.193.719,00	14.998.675,00	24.056.041,00	33.136.353,00
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	35.302.264,00	30.704.281,00	19.064.231,00	46.942.314,00
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	-	35.220,00	12.190,00	23.030,00
AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	1.243.984,00	681.290,00	241.103,00	1.684.171,00
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	170.340,00	117.042,00	91.573,00	195.809,00
AMUNDI SMART CITY	Classe UCITS ETF de capitalisation	1.210.547,00	-	935.510,00	275.037,00
AMUNDI SMART FACTORY	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	891.996,00	148.800,00	556.248,00	484.548,00
AMUNDI STOXX GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE	Classe UCITS ETF de capitalisation	4.035.352,00	1.113.264,00	296.220,00	4.852.396,00
AMUNDI DAX 50 ESG	Classe UCITS ETF DR de capitalisation	116.480,00	186.070,00	21.000,00	281.550,00
AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	1.818.398,00	326.640,00	527.060,00	1.617.978,00
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB	Classe I14E de capitalisation	-	9.537,40	-	9.537,40
	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	9.681.979,00	1.624.945,00	4.296.030,00	7.010.894,00
AMUNDI BBB EURO CORPORATE INVESTMENT GRADE	Classe UCITS ETF EUR de capitalisation	8.071.501,00	5.936.000,00	10.260.000,00	3.747.501,00
AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE ESG	Classe UCITS ETF HEDGED EUR de capitalisation	15.371.000,00	8.152.806,00	6.631.417,00	16.892.389,00
	Classe UCITS ETF HEDGED MXN de capitalisation	63.000,00	200.000,00	213.400,00	49.600,00
	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	5.302.101,00	4.570.320,00	3.669.844,00	6.202.577,00
AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX	Classe UCITS ETF USD de capitalisation	1.505.500,00	660.500,00	892.000,00	1.274.000,00
AMUNDI GOVT BOND EURO BROAD INVESTMENT GRADE	Classe UCITS ETF DR EUR de capitalisation	2.120.000,00	567.000,00	1.206.000,00	1.481.000,00
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE	Classe UCITS ETF DR EUR de capitalisation	3.898.000,00	1.446.924,25	3.962.102,25	1.382.822,00
	Classe UCITS ETF DR EUR de capitalisation	883.600,00	413.588,00	458.837,00	838.351,00
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE 1-3	Classe UCITS ETF DR EUR de capitalisation	1.309.001,00	558.000,00	846.000,00	1.021.001,00

2 CHANGEMENT DANS LE NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION (suite)

Nom du compartiment	Nom de la classe	Actions en circulation au 01/10/21	Actions souscrites	Actions rachetées	Actions en circulation au 30/09/22
AMUNDI US TREASURY 1-3	Classe UCITS ETF DR USD de capitalisation	455.100,00	287.000,00	396.000,00	346.100,00
AMUNDI US TREASURY 3-7	Classe UCITS ETF DR USD de capitalisation	43.500,00	98.000,00	59.500,00	82.000,00
AMUNDI US TREASURY 7-10	Classe UCITS ETF DR - HEDGED EUR de capitalisation	31.000,00	14.530.421,00	6.064.890,00	8.496.531,00
	Classe UCITS ETF DR USD de capitalisation	814.700,00	1.393.833,00	1.382.024,00	826.509,00

3 PERFORMANCE

Les performances sont publiées conformément aux exigences de la Swiss Fund and Asset Management Association (SFAMA).

La performance historique ne représente pas un indicateur de performance actuelle ou future. Les données de performances ne tiennent pas compte des commissions de frais perçus lors de l'émission et du rachat des parts.

Libellé	Perf - 1 Y (Ptf) From 30/09/2021 to 30/09/2022	Perf - 1 Y (Bmk) From 30/09/2021 to 30/09/2022	Perf - 1 Y - Net - sliding (Ptf) From 30/09/2020 to 30/09/2021	Perf - 1 Y (Bmk) From 30/09/2020 to 30/09/2021
AMUNDI CAC 40 UCITS ETF DR - EUR	-10.60%	-11.03%	38.68%	38.10%
AMUNDI CAC 40 UCITS ETF DR - EUR	-10.60%	-11.03%	38.68%	38.10%
AMUNDI EURO STOXX 50 UCITS ETF DR - EUR	-15.53%	-15.91%	29.65%	29.08%
AMUNDI EURO STOXX 50 UCITS ETF DR - EUR	-28.60%	-28.92%	28.13%	27.58%
AMUNDI EURO STOXX 50 UCITS ETF DR - USD	-15.53%	-15.91%	29.65%	29.08%
AMUNDI JAPAN TOPIX UCITS ETF - DAILY HEDGED CHF	-8.94%	-8.06%	25.13%	26.42%
AMUNDI JAPAN TOPIX UCITS ETF - DAILY HEDGED EUR	-9.00%	-8.13%	25.22%	26.51%
AMUNDI JAPAN TOPIX UCITS ETF - DAILY HEDGED GBP	-7.95%	-7.07%	25.97%	27.23%
AMUNDI JAPAN TOPIX UCITS ETF - DAILY HEDGED USD	-7.12%	-6.23%	26.41%	27.71%
AMUNDI JAPAN TOPIX UCITS ETF - EUR	-15.76%	-15.31%	21.32%	22.04%
AMUNDI JAPAN TOPIX UCITS ETF - JPY	-7.62%	-7.13%	26.77%	27.52%
AMUNDI JPX-NIKKEI 400 UCITS ETF - DAILY HEDGED CHF	-9.07%	-8.74%	25.83%	26.30%
AMUNDI JPX-NIKKEI 400 UCITS ETF - DAILY HEDGED EUR	-9.16%	-8.83%	25.90%	26.37%
AMUNDI JPX-NIKKEI 400 UCITS ETF - DAILY HEDGED GBP	-8.12%	-7.79%	26.61%	27.08%
AMUNDI JPX NIKKEI 400 UCITS ETF - DAILY HEDGED USD	-7.26%	-6.93%	27.13%	27.60%
AMUNDI JPX-NIKKEI 400 UCITS ETF - EUR	-16.16%	-15.98%	21.65%	21.92%
AMUNDI JPX-NIKKEI 400 UCITS ETF - JPY	-8.06%	-7.87%	27.12%	27.40%
AMUNDI MSCI BRAZIL - UCITS ETF	3.68%	4.32%	20.10%	20.98%
AMUNDI MSCI CHINA UCITS ETF - EUR	-6.62%	-5.93%	18.28%	19.41%
AMUNDI MSCI CHINA UCITS ETF - USD	-21.07%	-20.48%	16.90%	18.01%
AMUNDI MSCI EASTERN EUROPE EX RUSSIA UCITS ETF - EUR	-38.64%	-38.55%	44.21%	44.59%
AMUNDI MSCI EASTERN EUROPE EX RUSSIA UCITS ETF - USD	-48.14%	-48.06%	42.52%	42.90%
AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF - EUR	-16.76%	-16.61%	14.86%	15.27%
AMUNDI MSCI EM ASIA UCITS ETF - USD	-29.64%	-29.51%	13.52%	13.93%
AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF - EUR	18.32%	18.59%	27.99%	28.84%
AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA UCITS ETF - USD	0.02%	0.24%	26.50%	27.34%
AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF - EUR	-15.05%	-14.96%	19.14%	19.60%
AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS UCITS ETF - USD	-28.19%	-28.11%	17.75%	18.20%
AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND UCITS ETF - EUR	-12.64%	-12.78%	31.39%	31.34%
AMUNDI MSCI INDIA UCITS ETF - EUR	5.06%	6.55%	52.48%	54.93%
AMUNDI MSCI INDIA UCITS ETF - USD	-11.20%	-9.94%	50.70%	53.12%
AMUNDI MSCI NORDIC UCITS ETF - EUR	-16.15%	-16.31%	30.93%	30.75%
AMUNDI MSCI SWITZERLAND UCITS ETF - CHF	-12.08%	-11.93%	15.94%	16.20%
AMUNDI MSCI SWITZERLAND UCITS ETF - EUR	-1.42%	-1.25%	15.54%	15.80%

3 PERFORMANCE (suite)

Libellé	Perf - 1 Y (Ptf) From 30/09/2020 to 30/09/2021	Perf - 1 Y (Bmk) From 30/09/2020 to 30/09/2021	Perf - 1 Y - Net - sliding (Ptf) From 30/09/2019 to 30/09/2020	Perf - 1 Y (Bmk) From 30/09/2019 to 30/09/2020
AMUNDI MSCI USA UCITS ETF - EUR	-2.44%	-2.52%	30.81%	30.70%
AMUNDI MSCI USA UCITS ETF - USD	-17.54%	-17.60%	29.18%	29.07%
AMUNDI MSCI WORLD UCITS ETF - EUR	-5.01%	-4.92%	30.23%	30.34%
AMUNDI MSCI WORLD UCITS ETF - USD	-19.70%	-19.63%	28.71%	28.82%
AMUNDI MSCI WORLD ENERGY UCITS ETF - EUR	50.43%	51.00%	70.95%	71.96%
AMUNDI MSCI WORLD ENERGY UCITS ETF - USD	27.16%	27.64%	68.95%	69.95%
AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE UCITS ETF - EUR	-3.75%	-3.55%	30.42%	30.71%
AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE UCITS ETF - USD	-18.64%	-18.47%	28.90%	29.18%
AMUNDI MSCI WORLD FINANCIALS UCITS ETF - EUR	-5.02%	-4.84%	54.59%	54.58%
AMUNDI MSCI WORLD FINANCIALS UCITS ETF - USD	-19.72%	-19.56%	52.78%	52.77%
AMUNDI RUSSELL 2000 UCITS ETF - EUR	-9.89%	-9.83%	48.80%	48.99%
AMUNDI RUSSELL 2000 UCITS ETF - USD	-23.83%	-23.78%	47.06%	47.25%
AMUNDI S&P 500 UCITS ETF - USD	-15.60%	-15.86%	29.96%	29.43%
AMUNDI S&P 500 UCITS ETF - EUR	-0.15%	-0.46%	31.49%	30.96%
AMUNDI S&P 500 UCITS ETF - DAILY HEDGED EUR	-17.76%	-17.67%	28.44%	28.28%
AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY UCITS ETF - EUR	-10.79%	-10.18%	40.84%	41.82%
AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY UCITS ETF - USD	-24.59%	-24.07%	39.19%	40.17%
AMUNDI SMART CITY UCITS ETF	-18.15%	-17.52%	19.76%	20.64%
AMUNDI SMART FACTORY UCITS ETF EUR	-24.89%	-24.33%	27.39%	28.30%
AMUNDI STOXX GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE - UCITS ETF	-15.39%	-14.80%	40.23%	41.22%
AMUNDI DAX 50 ESG	-22.73%	-22.89%	NA	NA
AMUNDI STOXX EUROPE 600 UCITS ETF - EUR	-12.67%	-12.67%	28.65%	28.69%
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB - I14E	NA	NA	NA	NA
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB - UCITS ETF DR EUR	-12.71%	-12.88%	28.91%	28.76%
AMUNDI BBB EURO CORPORATE INVESTMENT GRADE ESG - UCITS ETF DR - EUR	-16.34%	-16.01%	1.23%	1.61%
AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE UCITS ETF DR - HEDGED EUR	-1.70%	-1.41%	-0.18%	0.14%
AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE ESG - UCITS ETF DR - USD	-0.17%	0.08%	0.70%	0.98%
AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE ESG - UCITS ETF DR - HEDGED MXN	6.48%	6.87%	5.08%	5.37%
AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX UCITS ETF DR - USD	-21.13%	-21.28%	3.78%	4.10%
AMUNDI GOVT BOND EURO BROAD INVESTMENT GRADE UCITS ETF DR - EUR	-17.45%	-17.33%	-1.94%	-1.75%
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EUROMTS INVESTMENT GRADE UCITS ETF DR - EUR	-17.84%	-17.72%	-1.12%	-0.90%
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EUROMTS INVESTMENT GRADE UCITS ETF DR - EUR	-17.84%	-17.72%	-1.12%	-0.90%
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EUROMTS INVESTMENT GRADE 1-3 UCITS ETF - EUR	-4.72%	-4.64%	-0.40%	-0.20%
AMUNDI US TREASURY 1-3 UCITS ETF DR - USD	-4.93%	-4.82%	-0.15%	0.04%
AMUNDI US TREASURY 3-7 - UCITS ETF DR - USD	-11.17%	-11.09%	-1.86%	-1.67%
AMUNDI US TREASURY 7-10 UCITS ETF DR - USD	-15.35%	-15.22%	-4.78%	-4.61%
AMUNDI US TREASURY 7-10 UCITS ETF DR - HEDGED EUR	-16.85%	-16.86%		

RÈGLEMENT SUR LA PUBLICATION D'INFORMATIONS EN MATIÈRE DE DURABILITÉ DANS LE SECTEUR DES SERVICES FINANCIERS ("SFDR")

Règlement relatif à la publication d'informations

Le 18 décembre 2019, le Conseil européen et le Parlement européen ont annoncé qu'ils avaient trouvé un accord politique concernant le règlement relatif à la publication d'informations, qui vise à créer un cadre paneuropéen censé faciliter l'investissement durable. Le règlement relatif à la publication d'informations propose une approche harmonisée pour les communications relatives au développement durable destinées aux investisseurs dans le secteur des services financiers de l'Espace économique européen.

Pour des informations plus détaillées concernant la manière dont un Compartiment répond aux exigences du règlement relatif à la publication d'informations, veuillez consulter le supplément relatif au Compartiment concerné. Veuillez consulter également la section « Investissement durable » du Prospectus du Fonds et la Politique d'investissement responsable d'Amundi sur le site www.amundi.com.

Comme l'exige le règlement relatif à la publication d'informations, le Fonds fait les déclarations suivantes :

Dans le cadre de la Politique d'investissement responsable d'Amundi, Amundi a développé sa propre approche de notation ESG. La notation ESG d'Amundi vise à mesurer la performance ESG d'un émetteur, c'est-à-dire sa capacité à anticiper et à gérer les risques et opportunités en matière de durabilité inhérents à son secteur d'activité et à sa propre situation. En utilisant les notations ESG d'Amundi, les gestionnaires de portefeuille prennent en compte les risques en matière de durabilité dans leurs décisions d'investissement.

Les Compartiments sont classés comme suit :

Compartiments relevant de l'article 9

Les présents Compartiments ont un objectif durable et sont donc classés en vertu de l'article 9 selon le SFDR [Règlement (UE) 2019/2088 du Parlement européen et du Conseil du 27 avril 2019 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers]. Par conséquent, comme l'exige l'article 58 du RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ (UE) 2022/1288 DE LA COMMISSION, des informations détaillées sur les critères environnementaux ou sociaux prônés par le produit financier sont disponibles dans une annexe au présent rapport.

La présente annexe contient des informations concernant :

- L'atteinte de l'objectif d'investissement durable de ce produit financier ;
- Les principaux investissements, la répartition des actifs et la part des investissements dans les différents secteurs et sous-secteurs économiques ;
- Les investissements durables.

Liste du Compartiment relevant de l'article 9 au 30 septembre 2022 :
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB

Compartiments relevant de l'article 8

Les présents Compartiments œuvrent en faveur des critères environnementaux et sociaux, et sont donc classés en vertu de l'article 8 selon le SFDR [Règlement (UE) 2019/2088 du Parlement européen et du Conseil du 27 avril 2019 sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers]. Par conséquent, comme l'exige l'article 50, paragraphe 2, du RÈGLEMENT DÉLÉGUÉ (UE) 2022/1288 DE LA COMMISSION, des informations détaillées sur les critères environnementaux ou sociaux prônés par le produit financier sont disponibles dans une annexe au présent rapport. La présente annexe contient des informations concernant :

- L'atteinte des critères environnementaux ou sociaux prônés par les produits financiers ;
- Les principaux investissements, la répartition des actifs et la part des investissements dans les différents secteurs et sous-secteurs économiques ;
- Les investissements dans des activités économiques durables sur le plan environnemental.

Liste des Compartiments relevant de l'article 8 au 30 septembre 2022 :

AMUNDI CAC 40 ESG
AMUNDI DAX 50 ESG
AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG
AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE ESG
AMUNDI BBB EURO CORPORATE INVESTMENT GRADE ESG

Les autres Compartiments

Vu la focalisation des investissements et les classes d'actifs / les secteurs dans lesquels ils investissent, les gestionnaires d'investissement de tous les autres Compartiments, non classifiés comme relevant de l'article 8 ou de l'article 9 du règlement relatif à la publication d'informations, n'ont pas intégré la prise en considération d'activités économiques durables sur le plan environnemental au processus d'investissement du Compartiment. Il convient par conséquent de noter que les investissements sous-jacents de ces Compartiments ne tiennent pas compte les critères de l'UE relatifs aux activités économiques durables sur le plan environnemental.

Liste des autres Compartiments au 30 septembre 2022 :

AMUNDI EURO STOXX 50
AMUNDI JAPAN TOPIX
AMUNDI JPX-NIKKEI 400
AMUNDI MSCI BRAZIL
AMUNDI MSCI CHINA
AMUNDI MSCI EASTERN EUROPE EX RUSSIA
AMUNDI MSCI EM ASIA
AMUNDI MSCI EM LATIN AMERICA
AMUNDI MSCI EMERGING MARKETS
AMUNDI MSCI EUROPE EX SWITZERLAND
AMUNDI MSCI INDIA
AMUNDI MSCI NORDIC
AMUNDI MSCI SWITZERLAND
AMUNDI MSCI USA
AMUNDI MSCI WORLD
AMUNDI MSCI WORLD ENERGY
AMUNDI MSCI WORLD EX EUROPE
AMUNDI MSCI WORLD FINANCIALS

RÈGLEMENT SUR LA PUBLICATION D'INFORMATIONS EN MATIÈRE DE DURABILITÉ DANS LE SECTEUR DES SERVICES FINANCIERS ("SFDR")

Les autres Compartiments (suite)

Liste des autres Compartiments au 30 septembre 2022 (suite) :

AMUNDI RUSSELL 2000
AMUNDI S&P 500
AMUNDI S&P GLOBAL LUXURY
AMUNDI SMART CITY
AMUNDI SMART FACTORY
AMUNDI STOXX GLOBAL ARTIFICIAL INTELLIGENCE
AMUNDI GLOBAL EMERGING BOND MARKIT IBOXX
AMUNDI GOVT BOND EURO BROAD INVESTMENT GRADE
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE
AMUNDI GOVT BOND LOWEST RATED EURO INVESTMENT GRADE 1-3
AMUNDI US TREASURY 1-3
AMUNDI US TREASURY 3-7
AMUNDI US TREASURY 7-10

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif

environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement n'établit pas de liste d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit :
AMUNDI INDEX MSCI EUROPE ESG BROAD CTB

Identifiant d'entité juridique :
5493000LLOOP2JUYI637

Objectif d'investissement durable

Ce produit financier avait-il un objectif d'investissement durable ?



X

Oui



Non



Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental : 70,65 %**



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social :**



Il **promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu

d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ d'investissements durables



ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il **promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables**



Dans quelle mesure l'objectif d'investissement durable de ce produit financier a-t-il été atteint ?

Le Compartiment faisait la promotion des caractéristiques environnementales et/ou sociales, notamment en répliquant un indice respectant les normes minimales des Indices de référence « Accord de Paris » de l'UE dans le cadre du Règlement (UE) 2019/2089 modifiant le Règlement (UE) 2016/1011.

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Date	Indice	Intensité carbone	Couverture
30/11/2022	MSCI Europe ESG Broad CTB Select Index	310.612	100,0 %
30/11/2022	MSCI EUROPE	543.423	99,5 %

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Les indicateurs de durabilité ci-dessus n'ont pas été comparés à d'autres indicateurs précédents durant les périodes précédentes dans la mesure où la réglementation n'était pas encore en vigueur

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entend partiellement réaliser, et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Les objectifs des investissements durables étaient d'investir dans des entreprises cherchant à respecter deux critères :

1. Suivre les meilleures pratiques environnementales et sociales ; et
2. Éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services causant un préjudice à l'environnement et à la société.

Au niveau de l'entreprise dans laquelle le Produit investit, cela veut dire qu'elle doit être une « entreprise la plus performante » au sein de ce secteur d'activité par rapport à l'un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants au moins. La définition d'entreprise « la plus performante » s'appuie sur une méthodologie ESG propre à Amundi, qui vise à mesurer la performance ESG d'une entreprise.

Pour être considérée comme « la plus performante », une entreprise doit obtenir la meilleure note parmi les trois premiers (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) de son secteur, sur au moins un facteur environnemental ou social important. Des facteurs environnementaux et sociaux importants sont identifiés au niveau du secteur. L'identification de ces facteurs est basée sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi qui combine des données extra-financières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme importants apportent une contribution de plus de 10 % au score ESG global.

Amundi considère le second critère comme respecté si l'entreprise n'a pas d'exposition significative à des activités non compatibles avec ces critères (par exemple le tabac, les armes, les jeux de hasard, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique).

● **Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?**

Pour s'assurer que les investissements durables ne causent pas de préjudice important (principe du « DNSH », ou « Do Not Significant Harm »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre « DNSH » repose sur le suivi d'indicateurs obligatoires des Principales Incidences Négatives, où les données solides sont disponibles via une combinaison d'indicateurs et de seuils ou règles spécifiques :

- Avoir une intensité carbone qui n'appartient pas au dernier décile des entreprises du secteur (ne concerne que les secteurs à forte intensité)
- Avoir une diversité au sein du Conseil d'administration qui n'appartient pas au dernier décile des entreprises du secteur
- Être exempt de toute controverse en matière de conditions de travail et de droits de l'homme
- Être exempt de toute controverse en matière de biodiversité et de pollution

Amundi prend déjà en compte des Principales incidences négatives spécifiques dans sa politique d'exclusions dans le cadre de sa Politique d'investissement responsable. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des filtrages détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, les violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, le charbon et le tabac.

Au-delà des facteurs de durabilité spécifiques couverts par le premier filtre, Amundi a défini un second filtre afin de vérifier que l'entreprise n'aligne pas de mauvaises performances environnementales ou sociales globales par rapport aux autres entreprises de son secteur.

- ***Comment les indicateurs concernant les incidences négatives sur les facteurs de durabilité ont-ils été pris en considération ?***

Le premier filtre « DNSH » repose sur le suivi d'indicateurs obligatoires des Principales Incidences Négatives, où les données solides sont disponibles via une combinaison d'indicateurs et de seuils ou règles spécifiques comme décrit ci-dessus.

- ***Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ?***

Oui, les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés dans notre méthodologie de notation ESG. Notre outil de notation ESG propre évalue les émetteurs en utilisant les données disponibles auprès de nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle comporte un critère dédié appelé « Implication communautaire et droits de l'homme » qui est appliqué à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, notamment les chaînes d'approvisionnement

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

socialement responsables, les conditions de travail et les relations professionnelles. En outre, nous assurons un suivi des controverses sur une base trimestrielle au minimum, qui inclut des entreprises identifiées pour violations des droits de l'homme. Lorsque des controverses surviennent, les analystes évaluent la situation et appliquent un score à la controverse (en utilisant notre propre méthodologie de notation) et déterminent la meilleure marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour tous les trimestres pour suivre la tendance et les efforts de remédiation.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Amundi prend en compte tous les indicateurs obligatoires des Principales incidences négatives s'appliquant à la stratégie du Produit et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusions (normatives et sectorielles), l'engagement et les approches de vote :

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, par activité et par secteur, couvrant certains des principaux indicateurs de durabilité énumérés par le Règlement relatif à la publication d'informations.
- Engagement : L'engagement est un processus continu et ciblé visant à influencer les activités ou le comportement des entreprises. L'objectif de l'engagement peut être divisé en deux catégories : engager un émetteur à améliorer la façon dont il intègre la dimension environnementale et sociale, engager un émetteur à améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et de droits de l'homme ou d'autres questions de durabilité importantes pour la société et l'économie mondiale. Cette approche s'applique à l'ensemble des produits Amundi. En 2021, Amundi s'est engagé auprès de 1 364 entreprise.
- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse holistique de toutes les questions à long terme pouvant influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour de plus amples informations, veuillez vous référer à la Politique d'Amundi en matière de Vote. Cette approche s'applique par défaut à l'ensemble des produits Amundi. En 2021, Amundi a voté pour 4 008 entreprises.

Suivi des controverses : Amundi a développé un système de suivi des controverses qui repose sur trois fournisseurs de données afin de suivre systématiquement les controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie par une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par les analystes ESG et par une révision périodique de son évolution. Cette approche s'applique à l'ensemble des fonds Amundi.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : Du 01/10/2021 au 30/09/2022

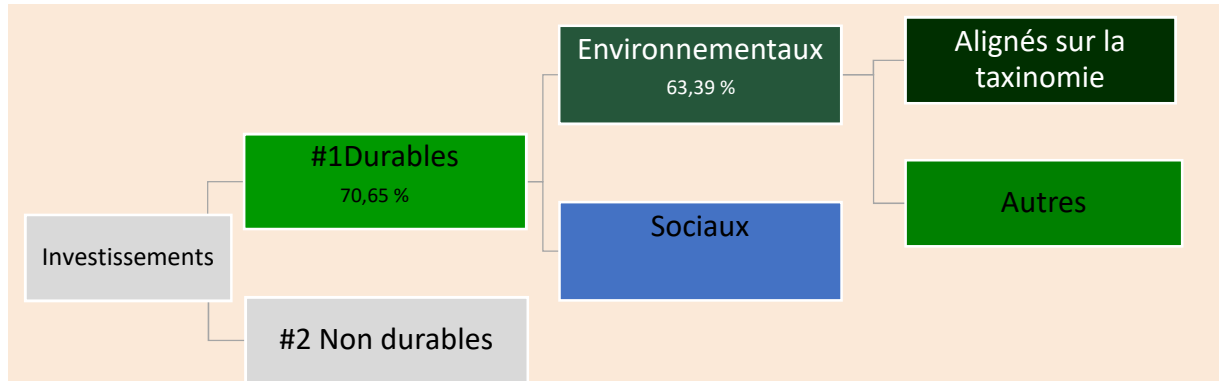
Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
NESTLE SA-REG	Produits alimentaires	3,59 %	États-Unis
ASML HOLDING NV	Semi-conducteurs & Équipements pour leur fabrication	2,98 %	NLD
NOVO NORDISK A/S-B NEW	Produits pharmaceutiques	2,67 %	DNK
ROCHE HLDG AG-GENUSS	Produits pharmaceutiques	2,65 %	États-Unis
DIAGEO	Boissons	2,51 %	GBR
ASTRAZENECA GBP	Produits pharmaceutiques	2,42 %	GBR
NOVARTIS	Produits pharmaceutiques	1,87 %	CHE
ZURICH INSURANCE GROUP AG	Assurance	1,82 %	CHE
SCHNEIDER ELECT SE	Équipements électriques	1,72 %	États-Unis
ALLIANZ SE-REG	Assurance	1,58 %	DEU
SAP SE	Logiciels	1,55 %	DEU
L OREAL	Produits de soins personnels	1,47 %	FRA
HSBC HOLDING PLC GBP	Banques	1,39 %	GBR
IBERDROLA SA	Services aux collectivités Électricité	1,30 %	ESP
CRH PLC - IRL	Matériaux de construction	1,21 %	IRL



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Quelle était l'allocation des actifs ?

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



La catégorie **#1 Durables** couvre les investissements durables ayant des objectifs environnementaux ou sociaux.

La catégorie **#2 Non durables** inclut les investissements qui ne sont pas qualifiés d'investissements durables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
<i>Produits pharmaceutiques</i>	11,92 %
<i>Banques</i>	8,22 %
<i>Assurance</i>	7,39 %
<i>Produits alimentaires</i>	6,22 %
<i>Boissons</i>	4,68 %
<i>Semi-conducteurs & Équipements pour leur fabrication</i>	4,04 %

<i>Services aux collectivités Électricité</i>	3,86 %
<i>Produits chimiques</i>	3,85 %
<i>Textiles, Habillement et Produits de luxe</i>	3,84 %
<i>Équipements électriques</i>	3,00 %
<i>Marchés des capitaux</i>	2,89 %
<i>Métaux & Mines</i>	2,33 %
<i>Services de télécommunication diversifiés</i>	2,24 %
<i>Produits de soins personnels</i>	2,23 %
<i>Pétrole, gaz & Combustibles fossiles</i>	2,21 %
<i>Logiciels</i>	2,11 %
<i>Services professionnels</i>	1,93 %
<i>FPI d'actions</i>	1,84 %
<i>Machines</i>	1,67 %
<i>Équipements & Fournitures médicaux</i>	1,62 %
<i>Multi-services aux collectivités</i>	1,53 %
<i>Papier & Industrie du bois</i>	1,47 %
<i>Matériaux de construction</i>	1,41 %

<i>Outils & Services Sciences de la vie</i>	1,36 %
<i>Composants automobiles</i>	1,28 %
<i>Sociétés de commerce & Distributeurs</i>	1,28 %
<i>Transport maritime</i>	0,98 %
<i>Distribution alimentaire & Pharmacie</i>	0,96 %
<i>Construction & Ingénierie</i>	0,88 %
<i>Distribution spécialisée</i>	0,79 %
<i>Produits domestiques</i>	0,79 %
<i>Internet & Marketing direct de détail</i>	0,68 %
<i>Hôtels, Restaurants & Loisirs</i>	0,61 %
<i>Industrie aérospatiale & Défense</i>	0,61 %
<i>Conglomérats industriels</i>	0,59 %
<i>Compagnies gazières</i>	0,58 %
<i>Équipements de communication</i>	0,55 %
<i>Produits domestiques durables</i>	0,54 %
<i>Matériels de construction</i>	0,49 %
<i>Équipements & Services Énergie</i>	0,46 %

<i>Services de télécommunication mobile</i>	<i>0,43 %</i>
<i>Automobiles</i>	<i>0,42 %</i>
<i>Services informatiques</i>	<i>0,41 %</i>
<i>Services financiers diversifiés</i>	<i>0,39 %</i>
<i>Transports</i>	<i>0,30 %</i>
<i>Médias</i>	<i>0,26 %</i>
<i>Emballages & Conteneurs</i>	<i>0,21 %</i>
<i>Fret aérien & Logistique</i>	<i>0,19 %</i>
<i>Biotechnologie</i>	<i>0,19 %</i>
<i>Gestion & Promotion immobilière</i>	<i>0,15 %</i>
<i>Divertissements</i>	<i>0,12 %</i>
<i>Prestataires & Services de santé</i>	<i>0,12 %</i>
<i>Équipements, instruments & composants électroniques</i>	<i>0,11 %</i>
<i>Médias interactifs & Services</i>	<i>0,07 %</i>
<i>Distributeurs</i>	<i>0,06 %</i>
<i>Services aux collectivités Eau</i>	<i>0,05 %</i>
<i>Services commerciaux & Provisions de bureaux</i>	<i>0,05 %</i>

Technologie Matériel informatique, Stockage de données & Périphériques	0,03 %
Compagnies aériennes	0,03 %
Multiline Retail	0,03 %
Producteurs Énergie indépendants et Commerce d'énergie	0,02 %
Forex	0,00 %
Autres	0,00 %
Liquidités	0,41 %

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

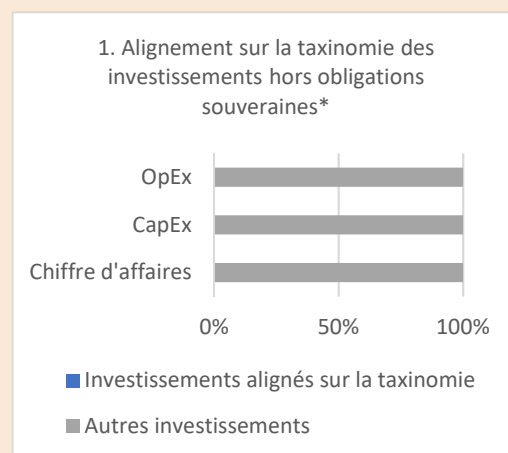
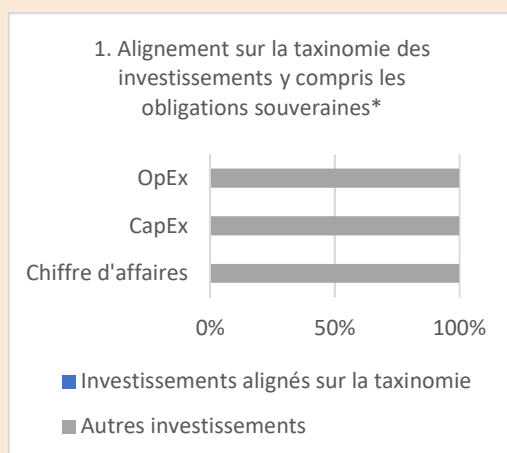
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- des **dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Aucune donnée fiable relative à la taxinomie de l'UE n'était disponible durant la période.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



Données non encore disponibles

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.


Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres choses, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

- **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Aucune donnée fiable relative aux activités transitoires et habilitantes n'était disponible durant la période.

- **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Aucune donnée fiable relative à la taxinomie de l'UE n'était disponible durant les périodes de référence précédentes.

 représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.



- **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

La part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie est de **63,39 %**.

Cela est dû au fait que certains émetteurs sont considérés comme des investissements durables au titre du Règlement SFDR mais contiennent une part d'activités qui ne sont pas alignées sur les normes de la taxinomie de l'UE, ou pour lesquelles aucune donnée n'est encore disponible pour voir réaliser une évaluation en termes de taxinomie de l'UE.



- **Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?**

Ce produit ne s'engage pas à avoir des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « non durables », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?**

« #2 Autres » inclut des liquidités et des instruments non cotés détenus à des fins de gestion du risque de liquidité et de portefeuille. Il n'y avait aucune garantie environnementale ou sociale minimale en place pour ces investissements.



Quelles mesures ont été prises pour atteindre l'objectif d'investissement durable au cours de la période de référence ?

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Les éléments contraignants dans la méthodologie de l'Indice permettent de s'assurer que les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont respectées à chaque date de rééquilibrage. La Stratégie du produit repose également sur des politiques d'exclusions systématiques (normatives et sectorielles) telles que les plus avancées dans la Politique d'investissement responsable d'Amundi.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative.

- **En quoi l'indice de référence différerait-il d'un indice de marché large ?**

MSCI Europe ESG Broad CTB Select Index est un indice d'actions basé sur le MSCI Europe Index, représentatif des grandes et moyennes capitalisations dans les pays des marchés développés en Europe (l'« Indice parent »). L'Indice exclut les entreprises dont les produits ont des incidences négatives sur le plan social ou environnemental, tout en surpondérant les entreprises affichant un excellent score ESG. En outre, l'Indice vise à représenter la performance d'une stratégie qui pondère les titres en fonction des opportunités et des risques associés à la transition climatique afin de rencontrer les exigences minimales de l'indice de référence « Transition climatique » de l'Union européenne.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur l'objectif d'investissement durable ?**

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Partant, les indicateurs de durabilité du Produit ont, dans l'ensemble, performé conformément à ceux de l'Indice.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Partant, les indicateurs de durabilité du Produit ont, dans l'ensemble, performé conformément à ceux de l'Indice.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Une comparaison de l'Indice répliqué par le Compartiment par rapport à son Indice parent a déjà été détaillée à la section Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales promues.

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement n'établit pas de liste d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit :
AMUNDI CAC 40 ESG

Identifiant d'entité juridique :
549300TC0PVE58KW9N64

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de **84,32 %** d'investissements durables

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il **promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

L'objectif d'investissement du Produit est de répliquer un Indice, basé sur un Indice parent. À chaque date de rééquilibrage de l'Indice, au moins 20 % des éléments constitutifs de l'Indice parent ont été supprimés sur la base de critères de durabilité, dont une notation « ESG » (environnementale, sociale et de gouvernance).

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Date	Indice	Score ESG moyen pondéré	Couverture
T3 2022	CAC 40 ESG NR	68	100 %
T3 2022	CAC 40	65	100 %

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Les indicateurs de durabilité ci-dessus n'ont pas été comparés à d'autres indicateurs précédents durant les périodes précédentes dans la mesure où la réglementation n'était pas encore en vigueur

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entend partiellement réaliser, et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Les objectifs des investissements durables étaient d'investir dans des entreprises cherchant à respecter deux critères :

1. Suivre les meilleures pratiques environnementales et sociales ; et
2. Éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services causant un préjudice à l'environnement et à la société.

Au niveau de l'entreprise dans laquelle le Produit investit, cela veut dire qu'elle doit être une « entreprise la plus performante » au sein de ce secteur d'activité par rapport à l'un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants au moins. La définition d'entreprise « la plus performante » s'appuie sur une méthodologie ESG propre à Amundi, qui vise à mesurer la performance ESG d'une entreprise.

Pour être considérée comme « la plus performante », une entreprise doit obtenir la meilleure note parmi les trois premiers (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) de son secteur, sur au moins un facteur environnemental ou social important. Des facteurs environnementaux et sociaux importants sont identifiés au niveau du secteur. L'identification de ces facteurs est basée sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi qui combine des données extra-financières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme importants apportent une contribution de plus de 10 % au score ESG global.

Amundi considère le second critère comme respecté si l'entreprise n'a pas d'exposition significative à des activités non compatibles avec ces critères (par exemple le tabac, les armes, les jeux de hasard, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique).

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- ***Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?***

Pour s'assurer que les investissements durables ne causent pas de préjudice important (principe du « DNSH », ou « Do Not Significant Harm »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre « DNSH » repose sur le suivi d'indicateurs obligatoires des Principales Incidences Négatives, où les données solides sont disponibles via une combinaison d'indicateurs et de seuils ou règles spécifiques :

- Avoir une intensité carbone qui n'appartient pas au dernier décile des entreprises du secteur (ne concerne que les secteurs à forte intensité)
- Avoir une diversité au sein du Conseil d'administration qui n'appartient pas au dernier décile des entreprises du secteur
- Être exempt de toute controverse en matière de conditions de travail et de droits de l'homme
- Être exempt de toute controverse en matière de biodiversité et de pollution

Amundi prend déjà en compte des Principales incidences négatives spécifiques dans sa politique d'exclusions dans le cadre de sa Politique d'investissement responsable. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des filtrages détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, les violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, le charbon et le tabac.

Au-delà des facteurs de durabilité spécifiques couverts par le premier filtre, Amundi a défini un second filtre afin de vérifier que l'entreprise n'aligne pas de mauvaises performances environnementales ou sociales globales par rapport aux autres entreprises de son secteur.

- ***Comment les indicateurs concernant les incidences négatives sur les facteurs de durabilité ont-ils été pris en considération ?***

Le premier filtre « DNSH » repose sur le suivi d'indicateurs obligatoires des Principales Incidences Négatives, où les données solides sont disponibles via une combinaison d'indicateurs et de seuils ou règles spécifiques comme décrit ci-dessus.

- ***Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :***

Oui, les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés dans notre méthodologie de notation ESG. Notre outil de notation ESG propre évalue les émetteurs en utilisant les données disponibles auprès de nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle comporte un critère dédié appelé « Implication communautaire et droits de l'homme » qui est appliqué à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, notamment les chaînes d'approvisionnement socialement responsables, les conditions de travail et les relations professionnelles. En outre, nous assurons un suivi des controverses sur une base trimestrielle au minimum, qui inclut des entreprises identifiées pour violations des droits

de l'homme. Lorsque des controverses surviennent, les analystes évaluent la situation et appliquent un score à la controverse (en utilisant notre propre méthodologie de notation) et déterminent la meilleure marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour tous les trimestres pour suivre la tendance et les efforts de remédiation.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Amundi prend en compte tous les indicateurs obligatoires des Principales incidences négatives s'appliquant à la stratégie du Produit et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusions (normatives et sectorielles), l'engagement et les approches de vote :

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, par activité et par secteur, couvrant certains des principaux indicateurs de durabilité énumérés par le Règlement relatif à la publication d'informations.
- Engagement : L'engagement est un processus continu et ciblé visant à influencer les activités ou le comportement des entreprises. L'objectif de l'engagement peut être divisé en deux catégories : engager un émetteur à améliorer la façon dont il intègre la dimension environnementale et sociale, engager un émetteur à améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et de droits de l'homme ou d'autres questions de durabilité importantes pour la société et l'économie mondiale. Cette approche s'applique à l'ensemble des produits Amundi. En 2021, Amundi s'est engagé auprès de 1 364 entreprise.
- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse holistique de toutes les questions à long terme pouvant influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour de plus amples informations, veuillez vous référer à la Politique d'Amundi en matière de Vote. Cette approche s'applique par défaut à l'ensemble des produits Amundi. En 2021, Amundi a voté pour 4 008 entreprises.
- Suivi des controverses : Amundi a développé un système de suivi des controverses qui repose sur trois fournisseurs de données afin de suivre systématiquement les controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie par une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par les analystes ESG et par une révision périodique de son évolution. Cette approche s'applique à l'ensemble des fonds Amundi.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : Du 01/10/2021 au 30/09/2022

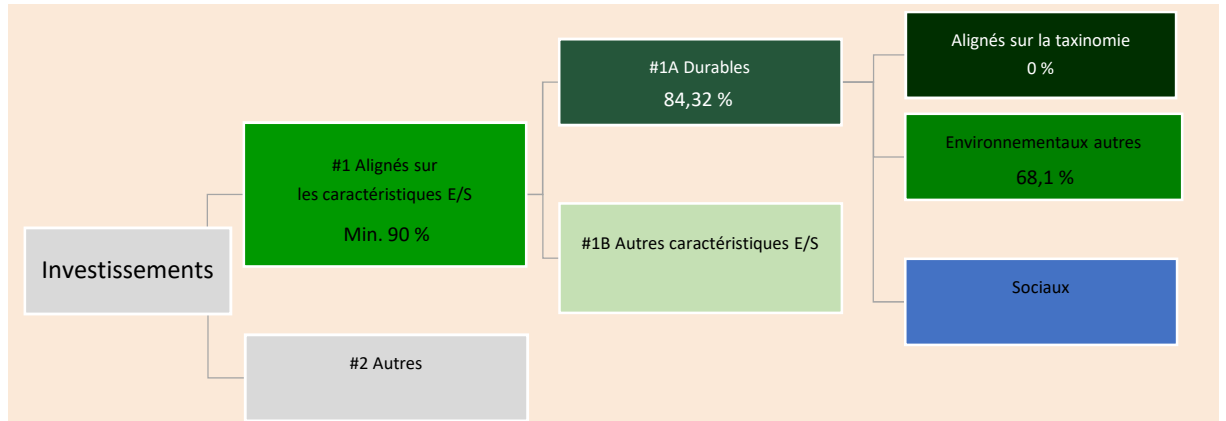
Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
LVMH MOET HENNESSY	Textiles, Habillement et Produits de luxe	10,07 %	FRA
SANOFI	Produits pharmaceutiques	8,50 %	FRA
L OREAL PRIME FID	Produits de soins personnels	7,58 %	FRA
SCHNEIDER ELECT SE	Équipements électriques	6,35 %	États-Unis
AIR LIQUIDE PRIME FID 02	Produits chimiques	5,70 %	FRA
AIRBUS SE	Industrie aérospatiale & Défense	4,99 %	FRA
BNP PARIBAS	Banques	4,60 %	FRA
VINCI SA (PARIS)	Construction & Ingénierie	4,25 %	FRA
AXA SA	Assurance	3,99 %	FRA
PERNOD RICARD	Boissons	3,70 %	FRA
HERMES INTERNATIONAL	Textiles, Habillement et Produits de luxe	3,66 %	FRA
KERING	Textiles, Habillement et Produits de luxe	3,26 %	FRA
SAFRAN	Industrie aérospatiale & Défense	3,05 %	FRA
DANONE	Produits alimentaires	2,96 %	FRA
CAPGEMINI	Services informatiques	2,44 %	FRA



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Quelle était l'allocation des actifs ?

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** inclut les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
<i>Textiles, Habillement et Produits de luxe</i>	16,99 %
<i>Produits pharmaceutiques</i>	8,50 %
<i>Industrie aérospatiale & Défense</i>	8,05 %
<i>Équipements électriques</i>	8,04 %

<i>Produits de soins personnels</i>	7,58 %
<i>Banques</i>	7,25 %
<i>Produits chimiques</i>	6,76 %
<i>Construction & Ingénierie</i>	4,25 %
<i>Assurance</i>	3,99 %
<i>Boissons</i>	3,70 %
<i>Services informatiques</i>	3,56 %
<i>Multi-services aux collectivités</i>	3,30 %
<i>Produits alimentaires</i>	2,96 %
<i>Services professionnels</i>	2,11 %
<i>Composants automobiles</i>	2,07 %
<i>Semi-conducteurs & Équipements pour leur fabrication</i>	1,95 %
<i>Médias</i>	1,65 %
<i>Matériels de construction</i>	1,65 %
<i>Services de télécommunication diversifiés</i>	1,64 %
<i>Hôtels, Restaurants & Loisirs</i>	0,97 %
<i>Distribution alimentaire & Pharmacie</i>	0,80 %

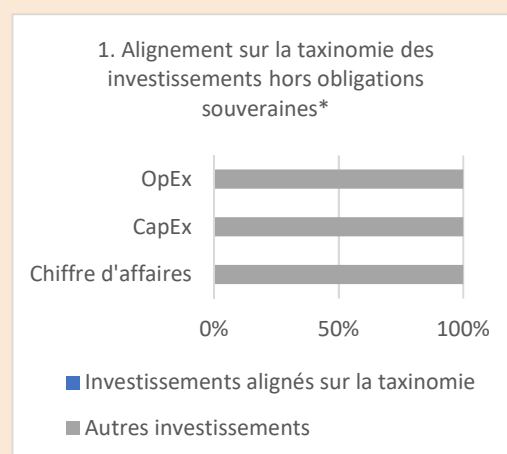
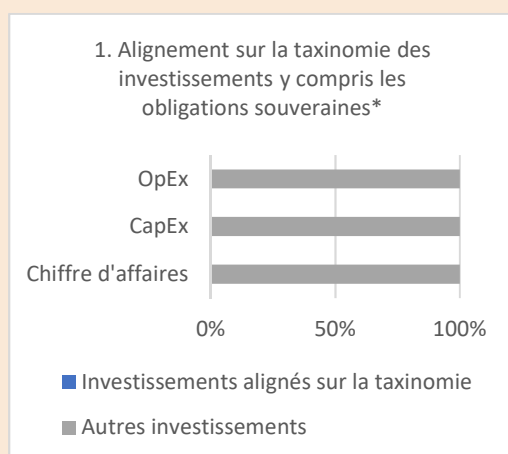
Services aux collectivités Électricité	0,66 %
Machines	0,51 %
FPI d'actions	0,45 %
Sociétés de commerce & Distributeurs	0,36 %
Autres	0,00 %
Liquidités	0,25 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Aucune donnée fiable relative à la taxinomie de l'UE n'était disponible durant la période.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



Données non encore disponibles

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Les **activités alignées sur la taxinomie** sont exprimées en pourcentage :

- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- des **dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres choses, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

- **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Aucune donnée fiable relative aux activités transitoires et habilitantes n'était disponible durant la période.

- **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Aucune donnée fiable relative à la taxinomie de l'UE n'était disponible durant les périodes de référence précédentes.



- **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

La part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie est de **68,1 %**.

Cela est dû au fait que certains émetteurs sont considérés comme des investissements durables au titre du Règlement SFDR mais contiennent une part d'activités qui ne sont pas alignées sur les normes de la taxinomie de l'UE, ou pour lesquelles aucune donnée n'est encore disponible pour pouvoir réaliser une évaluation en termes de taxinomie de l'UE.



- **Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?**

Ce produit ne s'engage pas à avoir des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?**

« #2 Autres » inclut des liquidités et des instruments non cotés détenus à des fins de gestion du risque de liquidité et de portefeuille. Il n'y avait aucune garantie environnementale ou sociale minimale en place pour ces investissements.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Les éléments contraignants dans la méthodologie de l'Indice permettent de s'assurer que les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont respectées à chaque date de rééquilibrage. La Stratégie du produit repose également sur des politiques d'exclusions systématiques (normatives et sectorielles) telles que décrites plus avant dans la Politique d'investissement responsable d'Amundi.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative.

- **En quoi l'indice de référence différait-il d'un indice de marché large ?**

CAC 40 ESG Index est un indice d'actions représentatif des quarante principales entreprises suivant des pratiques environnementales, sociales et de gouvernance strictes au sein du CAC Large 60 Index (l'« Indice parent »), qui représente les soixante principales actions sur le marché boursier de Paris. L'Indice vise à réduire l'empreinte carbone pondérée et à améliorer le ratio green-to-brown par rapport à son Indice parent.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Partant, les indicateurs de durabilité du Produit ont, dans l'ensemble, performé conformément à ceux de l'Indice.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Partant, les indicateurs de durabilité du Produit ont, dans l'ensemble, performé conformément à ceux de l'Indice.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Une comparaison de l'Indice répliqué par le Compartiment par rapport à son Indice parent a déjà été détaillée à la section Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales promues.

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement n'établit pas de liste d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit :
AMUNDI DAX 50 ESG

Identifiant d'entité juridique :
213800TB2ROJ7LC3AT12

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui

Non

Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif environnemental : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des investissements durables ayant un objectif social : ___%

Il promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S) et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de **68,2 %** d'investissements durables

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il promeut des caractéristiques E/S, mais **ne réalisera pas** d'investissements durables



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

L'objectif d'investissement du Compartiment est de répliquer un Indice, basé sur un Indice parent. À chaque date de rééquilibrage de l'Indice, au moins 20 % des éléments constitutifs de l'Indice parent ont été supprimés sur la base de critères de durabilité, dont une notation environnementale, sociale et de gouvernance (« ESG »).

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Date	Indice	Score ESG Sustainalytics	Couverture
19/09/2022	DAX 50 ESG (TR) EUR	76,39	100,00 %
19/09/2022	DAX	75,53	98,90 %

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Les indicateurs de durabilité ci-dessus n'ont pas été comparés à d'autres indicateurs précédents durant les périodes précédentes dans la mesure où la réglementation n'était pas encore en vigueur

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entend partiellement réaliser, et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Les objectifs des investissements durables étaient d'investir dans des entreprises cherchant à respecter deux critères :

1. Suivre les meilleures pratiques environnementales et sociales ; et
2. Éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services causant un préjudice à l'environnement et à la société.

Au niveau de l'entreprise dans laquelle le Produit investit, cela veut dire qu'elle doit être une « entreprise la plus performante » au sein de ce secteur d'activité par rapport à l'un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants au moins. La définition d'entreprise « la plus performante » s'appuie sur une méthodologie ESG propre à Amundi, qui vise à mesurer la performance ESG d'une entreprise.

Pour être considérée comme « la plus performante », une entreprise doit obtenir la meilleure note parmi les trois premiers (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) de son secteur, sur au moins un facteur environnemental ou social important. Des facteurs environnementaux et sociaux importants sont identifiés au niveau du secteur. L'identification de ces facteurs est basée sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi qui combine des données extra-financières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme importants apportent une contribution de plus de 10 % au score ESG global.

Amundi considère le second critère comme respecté si l'entreprise n'a pas d'exposition significative à des activités non compatibles avec ces critères (par exemple le tabac, les armes, les jeux de hasard, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique).

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- ***Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?***

Pour s'assurer que les investissements durables ne causent pas de préjudice important (principe du « DNSH », ou « Do Not Significant Harm »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre « DNSH » repose sur le suivi d'indicateurs obligatoires des Principales Incidences Négatives, où les données solides sont disponibles via une combinaison d'indicateurs et de seuils ou règles spécifiques :

- Avoir une intensité carbone qui n'appartient pas au dernier décile des entreprises du secteur (ne concerne que les secteurs à forte intensité)
- Avoir une diversité au sein du Conseil d'administration qui n'appartient pas au dernier décile des entreprises du secteur
- Être exempt de toute controverse en matière de conditions de travail et de droits de l'homme
- Être exempt de toute controverse en matière de biodiversité et de pollution

Amundi prend déjà en compte des Principales incidences négatives spécifiques dans sa politique d'exclusions dans le cadre de sa Politique d'investissement responsable. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des filtrages détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, les violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, le charbon et le tabac.

Au-delà des facteurs de durabilité spécifiques couverts par le premier filtre, Amundi a défini un second filtre afin de vérifier que l'entreprise n'aligne pas de mauvaises performances environnementales ou sociales globales par rapport aux autres entreprises de son secteur.

- ***Comment les indicateurs concernant les incidences négatives sur les facteurs de durabilité ont-ils été pris en considération ?***

Le premier filtre « DNSH » repose sur le suivi d'indicateurs obligatoires des Principales Incidences Négatives, où les données solides sont disponibles via une combinaison d'indicateurs et de seuils ou règles spécifiques comme décrit ci-dessus.

- ***Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :***

Oui, les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés dans notre méthodologie de notation ESG. Notre outil de notation ESG propre évalue les émetteurs en utilisant les données disponibles auprès de nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle comporte un critère dédié appelé « Implication communautaire et droits de l'homme » qui est appliqué à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, notamment les chaînes d'approvisionnement socialement responsables, les conditions de travail et les relations professionnelles. En outre, nous assurons un suivi des controverses sur une base trimestrielle au minimum, qui inclut des entreprises identifiées pour violations des droits

de l'homme. Lorsque des controverses surviennent, les analystes évaluent la situation et appliquent un score à la controverse (en utilisant notre propre méthodologie de notation) et déterminent la meilleure marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour tous les trimestres pour suivre la tendance et les efforts de remédiation.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Amundi prend en compte tous les indicateurs obligatoires des Principales incidences négatives s'appliquant à la stratégie du Produit et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusions (normatives et sectorielles), l'engagement et les approches de vote :

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, par activité et par secteur, couvrant certains des principaux indicateurs de durabilité énumérés par le Règlement relatif à la publication d'informations.
- Engagement : L'engagement est un processus continu et ciblé visant à influencer les activités ou le comportement des entreprises. L'objectif de l'engagement peut être divisé en deux catégories : engager un émetteur à améliorer la façon dont il intègre la dimension environnementale et sociale, engager un émetteur à améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et de droits de l'homme ou d'autres questions de durabilité importantes pour la société et l'économie mondiale. Cette approche s'applique à l'ensemble des produits Amundi. En 2021, Amundi s'est engagé auprès de 1 364 entreprise.
- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse holistique de toutes les questions à long terme pouvant influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour de plus amples informations, veuillez vous référer à la Politique d'Amundi en matière de Vote. Cette approche s'applique par défaut à l'ensemble des produits Amundi. En 2021, Amundi a voté pour 4 008 entreprises.
- Suivi des controverses : Amundi a développé un système de suivi des controverses qui repose sur trois fournisseurs de données afin de suivre systématiquement les controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie par une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par les analystes ESG et par une révision périodique de son évolution. Cette approche s'applique à l'ensemble des fonds Amundi.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : Du **01/10/2021** au **30/09/2022**

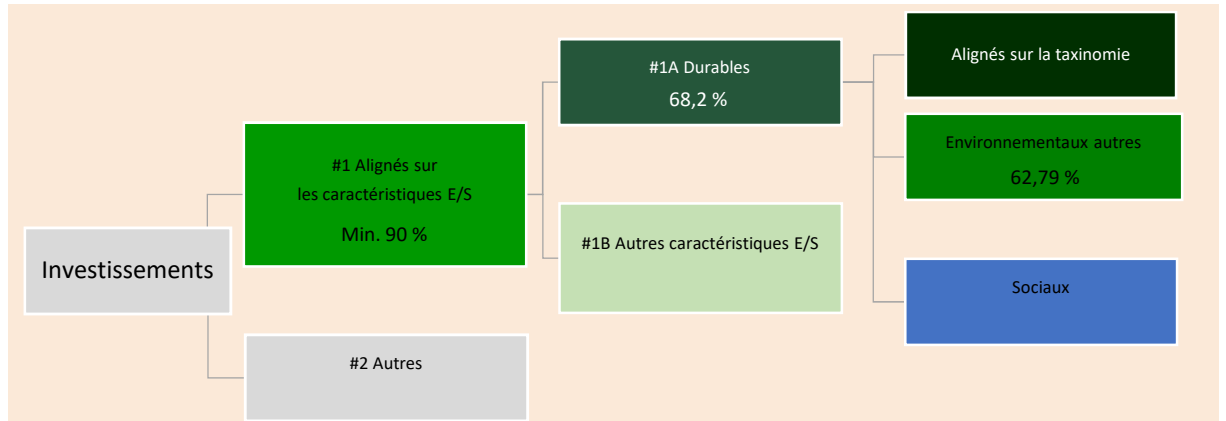
Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
SAP SE	Logiciels	7,34 %	DEU
SIEMENS AG-REG	Conglomérats industriels	7,32 %	DEU
LINDE PLC	Produits chimiques	7,31 %	GBR
ALLIANZ SE-REG	Assurance	7,20 %	DEU
DEUTSCHE TELEKOM NAM (XETRA)	Services de télécommunication diversifiés	6,93 %	DEU
BAYER AG	Produits pharmaceutiques	5,61 %	DEU
MERCEDES-BENZ GROUP AG	Automobiles	4,96 %	DEU
BASF SE XETRA	Produits chimiques	4,27 %	DEU
MUENCHENER RUECKVER	Assurance	4,14 %	DEU
DEUTSCHE BOERSE AG	Marchés des capitaux	3,72 %	DEU
DEUTSCHE POST AG-REG (XETRA)	Fret aérien & Logistique	3,63 %	DEU
INFINEON TECH. AG	Semi-conducteurs & Équipements pour leur fabrication	3,56 %	DEU
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	Automobiles	2,65 %	DEU
MERCK KGA	Produits pharmaceutiques	2,60 %	DEU
ADIDAS AG	Textiles, Habillement et Produits de luxe	2,41 %	DEU



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** inclut les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Produits chimiques	15,04 %
Assurance	12,45 %
Automobiles	8,68 %

<i>Produits pharmaceutiques</i>	8,20 %
<i>Logiciels</i>	7,34 %
<i>Conglomérats industriels</i>	7,32 %
<i>Services de télécommunication diversifiés</i>	6,93 %
<i>Marchés des capitaux</i>	5,60 %
<i>Fret aérien & Logistique</i>	3,63 %
<i>Semi-conducteurs & Équipements pour leur fabrication</i>	3,56 %
<i>Textiles, Habillement et Produits de luxe</i>	3,32 %
<i>Gestion & Promotion immobilière</i>	2,87 %
<i>Équipements & Fournitures médicaux</i>	1,96 %
<i>Prestataires & Services de santé</i>	1,79 %
<i>Produits domestiques</i>	1,23 %
<i>Produits de soins personnels</i>	1,19 %
<i>Sociétés de commerce & Distributeurs</i>	1,16 %
<i>Machines</i>	1,12 %
<i>Outils & Services Sciences de la vie</i>	1,06 %
<i>Banques</i>	0,93 %

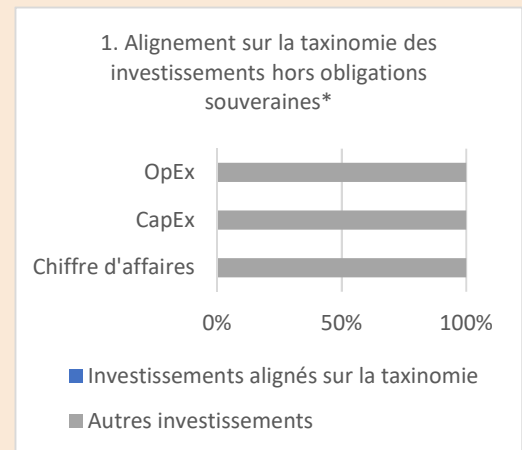
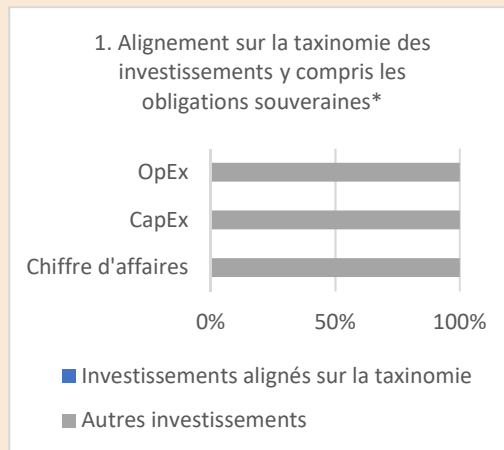
<i>Matériaux de construction</i>	<i>0,68 %</i>
<i>Compagnies aériennes</i>	<i>0,64 %</i>
<i>Équipements électriques</i>	<i>0,64 %</i>
<i>Composants automobiles</i>	<i>0,60 %</i>
<i>Internet & Marketing direct de détail</i>	<i>0,56 %</i>
<i>Médias interactifs & Services</i>	<i>0,48 %</i>
<i>Métaux & Mines</i>	<i>0,46 %</i>
<i>Services de télécommunication mobile</i>	<i>0,28 %</i>
<i>Autres</i>	<i>0,00 %</i>
<i>Liquidités</i>	<i>0,29 %</i>



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Aucune donnée fiable relative à la taxinomie de l'UE n'était disponible durant la période.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



Données non encore disponibles

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du chiffre d'affaires pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- des dépenses d'investissement (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des dépenses d'exploitation (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres choses, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

- **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Aucune donnée fiable relative aux activités transitoires et habilitantes n'était disponible durant la période.

- **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Aucune donnée fiable relative à la taxinomie de l'UE n'était disponible durant les périodes de référence précédentes.



- **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

La part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie est de **62,79 %**.

Cela est dû au fait que certains émetteurs sont considérés comme des investissements durables au titre du Règlement SFDR mais contiennent une part d'activités qui ne sont pas alignées sur les normes de la taxinomie de l'UE, ou pour lesquelles aucune donnée n'est encore disponible pour pouvoir réaliser une évaluation en termes de taxinomie de l'UE.



- **Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?**

Ce produit ne s'engage pas à avoir des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?**

« #2 Autres » inclut des liquidités et des instruments non cotés détenus à des fins de gestion du risque de liquidité et de portefeuille. Il n'y avait aucune garantie environnementale ou sociale minimale en place pour ces investissements.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de répllication y relative. Les éléments contraignants dans la méthodologie de l'Indice permettent de s'assurer que les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont respectées à chaque date de rééquilibrage. La Stratégie du produit repose également sur des politiques d'exclusions systématiques (normatives et sectorielles) telles que décrites plus avant dans la Politique d'investissement responsable d'Amundi.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de répllication y relative.

- ***En quoi l'indice de référence différait-il d'un indice de marché large ?***

Le DAX 50 ESG réplique la performance des cinquante principales actions qui affichent une performance comparable sur la base de leurs critères ESG (Environnemental, Social et de Gouvernance). L'Indice se compose de titres inclus dans le HDAX, qui est représentatif des grandes et moyennes entreprises dont les titres sont négociés sur le marché d'actions allemand, et ayant leur siège social ou d'exploitation situé en Allemagne.

L'univers du HDAX englobe l'ensemble des entreprises représentées dans le DAX (l'indice allemand des valeurs de premier plan qui suit la performance des quarante entreprises les plus importantes sur le marché boursier allemand en termes de capitalisation boursière et de chiffre d'affaires), le MDAX (composé des cinquante entreprises les plus importantes après le DAX en termes de capitalisation boursière et de chiffre d'affaires), et le TecDAX (qui inclut les trente valeurs technologiques les plus grandes et les plus liquides en termes de capitalisation boursière et de chiffre d'affaires).

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?***

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de répllication y relative. Partant, les indicateurs de durabilité du Produit ont, dans l'ensemble, performé conformément à ceux de l'Indice.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de répllication y relative. Partant, les indicateurs de durabilité du Produit ont, dans l'ensemble, performé conformément à ceux de l'Indice.

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de répllication y relative. Une comparaison de l'Indice répliqué par le Compartiment par rapport à son Indice parent a déjà été détaillée à la section Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales promues.

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement n'établit pas de liste d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit :
AMUNDI STOXX EUROPE 600 ESG

Identifiant d'entité juridique :
549300JX3L7U61W4HF88

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



X

Non



Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%



Il **promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de **64,54 %** d'investissements durables



ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il **promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

L'objectif d'investissement du Produit est de répliquer un Indice, basé sur un Indice parent. À chaque date de rééquilibrage de l'Indice, au moins 20 % des éléments constitutifs de l'Indice parent ont été supprimés sur la base de critères de durabilité, dont une notation « ESG » (environnementale, sociale et de gouvernance).

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Date	Indice	Score ESG Sustainalytics	Couverture
19/09/2022	STOXX Europe 600 ESG Broad Market EUR Net Return	75,49	100 %
19/09/2022	STOXX Europe 600	74,11	100 %

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Les indicateurs de durabilité ci-dessus n'ont pas été comparés à d'autres indicateurs précédents durant les périodes précédentes dans la mesure où la réglementation n'était pas encore en vigueur

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entend partiellement réaliser, et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Les objectifs des investissements durables étaient d'investir dans des entreprises cherchant à respecter deux critères :

1. Suivre les meilleures pratiques environnementales et sociales ; et
2. Éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services causant un préjudice à l'environnement et à la société.

Au niveau de l'entreprise dans laquelle le Produit investit, cela veut dire qu'elle doit être une « entreprise la plus performante » au sein de ce secteur d'activité par rapport à l'un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants au moins. La définition d'entreprise « la plus performante » s'appuie sur une méthodologie ESG propre à Amundi, qui vise à mesurer la performance ESG d'une entreprise.

Pour être considérée comme « la plus performante », une entreprise doit obtenir la meilleure note parmi les trois premiers (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) de son secteur, sur au moins un facteur environnemental ou social important. Des facteurs environnementaux et sociaux importants sont identifiés au niveau du secteur. L'identification de ces facteurs est basée sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi qui combine des données extra-financières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme importants apportent une contribution de plus de 10 % au score ESG global.

Amundi considère le second critère comme respecté si l'entreprise n'a pas d'exposition significative à des activités non compatibles avec ces critères (par exemple le tabac, les armes, les jeux de hasard, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique).

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- ***Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?***

Pour s'assurer que les investissements durables ne causent pas de préjudice important (principe du « DNSH », ou « Do Not Significant Harm »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre « DNSH » repose sur le suivi d'indicateurs obligatoires des Principales Incidences Négatives, où les données solides sont disponibles via une combinaison d'indicateurs et de seuils ou règles spécifiques :

- Avoir une intensité carbone qui n'appartient pas au dernier décile des entreprises du secteur (ne concerne que les secteurs à forte intensité)
- Avoir une diversité au sein du Conseil d'administration qui n'appartient pas au dernier décile des entreprises du secteur
- Être exempt de toute controverse en matière de conditions de travail et de droits de l'homme
- Être exempt de toute controverse en matière de biodiversité et de pollution

Amundi prend déjà en compte des Principales incidences négatives spécifiques dans sa politique d'exclusions dans le cadre de sa Politique d'investissement responsable. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des filtrages détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, les violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, le charbon et le tabac.

Au-delà des facteurs de durabilité spécifiques couverts par le premier filtre, Amundi a défini un second filtre afin de vérifier que l'entreprise n'aligne pas de mauvaises performances environnementales ou sociales globales par rapport aux autres entreprises de son secteur.

- ***Comment les indicateurs concernant les incidences négatives sur les facteurs de durabilité ont-ils été pris en considération ?***

Le premier filtre « DNSH » repose sur le suivi d'indicateurs obligatoires des Principales Incidences Négatives, où les données solides sont disponibles via une combinaison d'indicateurs et de seuils ou règles spécifiques comme décrit ci-dessus.

- ***Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :***

Oui, les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés dans notre méthodologie de notation ESG. Notre outil de notation ESG propre évalue les émetteurs en utilisant les données disponibles auprès de nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle comporte un critère dédié appelé « Implication communautaire et droits de l'homme » qui est appliqué à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, notamment les chaînes d'approvisionnement socialement responsables, les conditions de travail et les relations professionnelles. En outre, nous assurons un suivi des controverses sur une base trimestrielle au minimum, qui inclut des entreprises identifiées pour violations des droits

de l'homme. Lorsque des controverses surviennent, les analystes évaluent la situation et appliquent un score à la controverse (en utilisant notre propre méthodologie de notation) et déterminent la meilleure marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour tous les trimestres pour suivre la tendance et les efforts de remédiation.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Amundi prend en compte tous les indicateurs obligatoires des Principales incidences négatives s'appliquant à la stratégie du Produit et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusions (normatives et sectorielles), l'engagement et les approches de vote :

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, par activité et par secteur, couvrant certains des principaux indicateurs de durabilité énumérés par le Règlement relatif à la publication d'informations.
- Engagement : L'engagement est un processus continu et ciblé visant à influencer les activités ou le comportement des entreprises. L'objectif de l'engagement peut être divisé en deux catégories : engager un émetteur à améliorer la façon dont il intègre la dimension environnementale et sociale, engager un émetteur à améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et de droits de l'homme ou d'autres questions de durabilité importantes pour la société et l'économie mondiale. Cette approche s'applique à l'ensemble des produits Amundi. En 2021, Amundi s'est engagé auprès de 1 364 entreprise.
- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse holistique de toutes les questions à long terme pouvant influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour de plus amples informations, veuillez vous référer à la Politique d'Amundi en matière de Vote. Cette approche s'applique par défaut à l'ensemble des produits Amundi. En 2021, Amundi a voté pour 4 008 entreprises.
- Suivi des controverses : Amundi a développé un système de suivi des controverses qui repose sur trois fournisseurs de données afin de suivre systématiquement les controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie par une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par les analystes ESG et par une révision périodique de son évolution. Cette approche s'applique à l'ensemble des fonds Amundi.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : Du 01/10/2021 au 30/09/2022

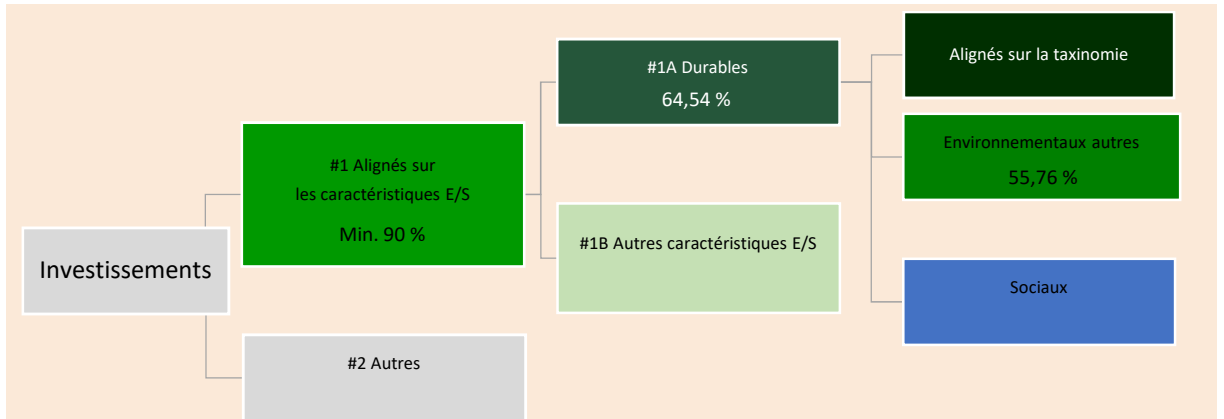
Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
NESTLE SA-REG	Produits alimentaires	3,99 %	États-Unis
ROCHE HLDG AG-GENUSS	Produits pharmaceutiques	3,08 %	États-Unis
SHELL PLC	Pétrole, gaz & Combustibles fossiles	2,43 %	NLD
NOVARTIS	Produits pharmaceutiques	2,32 %	CHE
ASML HOLDING NV	Semi-conducteurs & Équipements pour leur fabrication	2,31 %	NLD
ASTRAZENECA GBP	Produits pharmaceutiques	2,30 %	GBR
NOVO NORDISK A/S-B NEW	Produits pharmaceutiques	2,19 %	DNK
LVMH MOET HENNESSY	Textiles, Habillement et Produits de luxe	2,09 %	FRA
LINDE PLC	Produits chimiques	1,82 %	GBR
TOTALENERGIES SE PARIS	Pétrole, gaz & Combustibles fossiles	1,66 %	FRA
UNILEVER PLC (GBP)	Produits de soins personnels	1,56 %	GBR
HSBC HOLDING PLC GBP	Banques	1,42 %	GBR
DIAGEO	Boissons	1,29 %	GBR
BP PLC	Pétrole, gaz & Combustibles fossiles	1,22 %	GBR
SAP SE	Logiciels	1,20 %	DEU



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Quelle était l'allocation des actifs ?

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** inclut les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
Produits pharmaceutiques	13,16 %
Banques	7,79 %
Pétrole, gaz & Combustibles fossiles	6,86 %
Assurance	5,53 %

<i>Produits alimentaires</i>	5,16 %
<i>Produits chimiques</i>	4,55 %
<i>Textiles, Habillement et Produits de luxe</i>	4,39 %
<i>Semi-conducteurs & Équipements pour leur fabrication</i>	3,24 %
<i>Boissons</i>	3,10 %
<i>Marchés des capitaux</i>	2,93 %
<i>Produits de soins personnels</i>	2,75 %
<i>Machines</i>	2,46 %
<i>Équipements électriques</i>	2,25 %
<i>Services de télécommunication diversifiés</i>	2,25 %
<i>Équipements & Fournitures médicaux</i>	2,20 %
<i>Automobiles</i>	2,07 %
<i>Services professionnels</i>	2,06 %
<i>Logiciels</i>	1,63 %
<i>Services aux collectivités Électricité</i>	1,47 %
<i>Métaux & Mines</i>	1,42 %
<i>Sociétés de commerce & Distributeurs</i>	1,27 %

<i>Services informatiques</i>	1,23 %
<i>Construction & Ingénierie</i>	1,22 %
<i>Conglomérats industriels</i>	1,16 %
<i>Multi-services aux collectivités</i>	1,09 %
<i>Matériels de construction</i>	1,05 %
<i>Hôtels, Restaurants & Loisirs</i>	1,01 %
<i>Outils & Services Sciences de la vie</i>	0,98 %
<i>Distribution alimentaire & Pharmacie</i>	0,96 %
<i>Produits domestiques</i>	0,96 %
<i>FPI d'actions</i>	0,81 %
<i>Papier & Industrie du bois</i>	0,77 %
<i>Matériaux de construction</i>	0,75 %
<i>Fret aérien & Logistique</i>	0,73 %
<i>Internet & Marketing direct de détail</i>	0,67 %
<i>Services financiers diversifiés</i>	0,65 %
<i>Médias</i>	0,60 %
<i>Équipements de communication</i>	0,56 %

<i>Distribution spécialisée</i>	<i>0,55 %</i>
<i>Gestion & Promotion immobilière</i>	<i>0,54 %</i>
<i>Services de télécommunication mobile</i>	<i>0,47 %</i>
<i>Équipements, instruments & composants électroniques</i>	<i>0,45 %</i>
<i>Transports</i>	<i>0,37 %</i>
<i>Emballages & Conteneurs</i>	<i>0,37 %</i>
<i>Composants automobiles</i>	<i>0,33 %</i>
<i>Services commerciaux & Provisions de bureaux</i>	<i>0,33 %</i>
<i>Transport maritime</i>	<i>0,28 %</i>
<i>Compagnies gazières</i>	<i>0,28 %</i>
<i>Produits domestiques durables</i>	<i>0,26 %</i>
<i>Prestataires & Services de santé</i>	<i>0,22 %</i>
<i>Services aux collectivités Eau</i>	<i>0,22 %</i>
<i>Compagnies aériennes</i>	<i>0,16 %</i>
<i>Médias interactifs & Services</i>	<i>0,13 %</i>
<i>Technologie Matériel informatique, Stockage de données & Périphériques</i>	<i>0,11 %</i>

<i>Multiline Retail</i>	<i>0,10 %</i>
<i>Producteurs Énergie indépendants et Commerce d'énergie</i>	<i>0,09 %</i>
<i>Biotechnologie</i>	<i>0,09 %</i>
<i>Équipements & Services Énergie</i>	<i>0,08 %</i>
<i>Divertissements</i>	<i>0,05 %</i>
<i>Distributeurs</i>	<i>0,03 %</i>
<i>Produits de loisirs</i>	<i>0,02 %</i>
<i>Autres</i>	<i>0,00 %</i>
<i>Liquidités</i>	<i>0,75 %</i>

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :

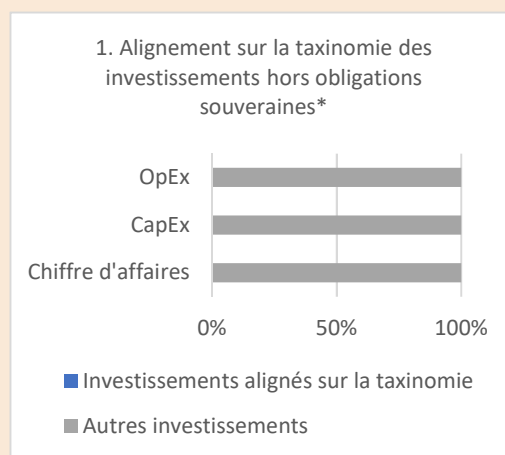
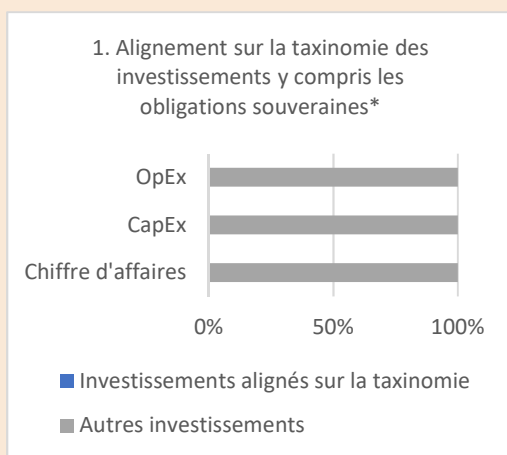
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- des **dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Aucune donnée fiable relative à la taxinomie de l'UE n'était disponible durant la période.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



Données non encore disponibles

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres choses, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

- **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Aucune donnée fiable relative aux activités transitoires et habilitantes n'était disponible durant la période.

- **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Aucune donnée fiable relative à la taxinomie de l'UE n'était disponible durant les périodes de référence précédentes.



- **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

La part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie est de **55,76 %**.

Cela est dû au fait que certains émetteurs sont considérés comme des investissements durables au titre du Règlement SFDR mais contiennent une part d'activités qui ne sont pas alignées sur les normes de la taxinomie de l'UE, ou pour lesquelles aucune donnée n'est encore disponible pour pouvoir réaliser une évaluation en termes de taxinomie de l'UE.



- **Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?**

Ce produit ne s'engage pas à avoir des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?**

« #2 Autres » inclut des liquidités et des instruments non cotés détenus à des fins de gestion du risque de liquidité et de portefeuille. Il n'y avait aucune garantie environnementale ou sociale minimale en place pour ces investissements.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Les éléments contraignants dans la méthodologie de l'Indice permettent de s'assurer que les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont respectées à chaque date de rééquilibrage. La Stratégie du produit repose également sur des politiques d'exclusions systématiques (normatives et sectorielles) telles que décrites plus avant dans la Politique d'investissement responsable d'Amundi.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative.

- **En quoi l'indice de référence différait-il d'un indice de marché large ?**

STOXX Europe 600 ESG Broad Market Index est un indice d'actions basé sur Stoxx Europe 600 - représentant les 600 principaux titres des pays développés européens (l'« Indice parent ») qui applique une série d'exclusions sectorielles et de filtres de performance ESG pour la sélection des titres, et vise une sélection totale de 80 % du nombre de titres de l'Indice parent.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Partant, les indicateurs de durabilité du Produit ont, dans l'ensemble, performé conformément à ceux de l'Indice.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Partant, les indicateurs de durabilité du Produit ont, dans l'ensemble, performé conformément à ceux de l'Indice.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Une comparaison de l'Indice répliqué par le Compartiment par rapport à son Indice parent a déjà été détaillée à la section Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales promues.

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement n'établit pas de liste d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit :

AMUNDI BBB EURO CORPORATE INVESTMENT GRADE ESG

Identifiant d'entité juridique :

549300YTYLJO4SGWFT69

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

Oui **Non**

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%

dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%

Il **promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de **59,1 %** d'investissements durables

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

ayant un objectif social

Il **promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

L'objectif d'investissement du Produit est de répliquer un Indice, basé sur un Indice parent. À chaque date de rééquilibrage de l'Indice, au moins 20 % des éléments constitutifs de l'Indice parent ont été supprimés sur la base de critères de durabilité, dont une notation « ESG » (environnementale, sociale et de gouvernance).

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Indice	Score ESG	Couverture
iBoxx MSCI ESG EUR Corporates BBB TCA Index	AAA (MSCI ESG rating)	100 %

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Les indicateurs de durabilité ci-dessus n'ont pas été comparés à d'autres indicateurs précédents durant les périodes précédentes dans la mesure où la réglementation n'était pas encore en vigueur

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entend partiellement réaliser, et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Les objectifs des investissements durables étaient d'investir dans des entreprises cherchant à respecter deux critères :

1. Suivre les meilleures pratiques environnementales et sociales ; et
2. Éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services causant un préjudice à l'environnement et à la société.

Au niveau de l'entreprise dans laquelle le Produit investit, cela veut dire qu'elle doit être une « entreprise la plus performante » au sein de ce secteur d'activité par rapport à l'un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants au moins. La définition d'entreprise « la plus performante » s'appuie sur une méthodologie ESG propre à Amundi, qui vise à mesurer la performance ESG d'une entreprise.

Pour être considérée comme « la plus performante », une entreprise doit obtenir la meilleure note parmi les trois premiers (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) de son secteur, sur au moins un facteur environnemental ou social important. Des facteurs environnementaux et sociaux importants sont identifiés au niveau du secteur. L'identification de ces facteurs est basée sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi qui combine des données extra-financières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme importants apportent une contribution de plus de 10 % au score ESG global.

Amundi considère le second critère comme respecté si l'entreprise n'a pas d'exposition significative à des activités non compatibles avec ces critères (par exemple le tabac, les armes, les jeux de hasard, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique).

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- ***Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?***

Pour s'assurer que les investissements durables ne causent pas de préjudice important (principe du « DNSH », ou « Do Not Significant Harm »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre « DNSH » repose sur le suivi d'indicateurs obligatoires des Principales Incidences Négatives, où les données solides sont disponibles via une combinaison d'indicateurs et de seuils ou règles spécifiques :

- Avoir une intensité carbone qui n'appartient pas au dernier décile des entreprises du secteur (ne concerne que les secteurs à forte intensité)
- Avoir une diversité au sein du Conseil d'administration qui n'appartient pas au dernier décile des entreprises du secteur
- Être exempt de toute controverse en matière de conditions de travail et de droits de l'homme
- Être exempt de toute controverse en matière de biodiversité et de pollution

Amundi prend déjà en compte des Principales incidences négatives spécifiques dans sa politique d'exclusions dans le cadre de sa Politique d'investissement responsable. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des filtrages détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, les violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, le charbon et le tabac.

Au-delà des facteurs de durabilité spécifiques couverts par le premier filtre, Amundi a défini un second filtre afin de vérifier que l'entreprise n'aligne pas de mauvaises performances environnementales ou sociales globales par rapport aux autres entreprises de son secteur.

- ***Comment les indicateurs concernant les incidences négatives sur les facteurs de durabilité ont-ils été pris en considération ?***

Le premier filtre « DNSH » repose sur le suivi d'indicateurs obligatoires des Principales Incidences Négatives, où les données solides sont disponibles via une combinaison d'indicateurs et de seuils ou règles spécifiques comme décrit ci-dessus.

- ***Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :***

Oui, les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés dans notre méthodologie de notation ESG. Notre outil de notation ESG propre évalue les émetteurs en utilisant les données disponibles auprès de nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle comporte un critère dédié appelé « Implication communautaire et droits de l'homme » qui est appliqué à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, notamment les chaînes d'approvisionnement socialement responsables, les conditions de travail et les relations professionnelles. En outre, nous assurons un suivi des controverses sur une base trimestrielle au minimum, qui inclut des entreprises identifiées pour violations des droits

de l'homme. Lorsque des controverses surviennent, les analystes évaluent la situation et appliquent un score à la controverse (en utilisant notre propre méthodologie de notation) et déterminent la meilleure marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour tous les trimestres pour suivre la tendance et les efforts de remédiation.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Amundi prend en compte tous les indicateurs obligatoires des Principales incidences négatives s'appliquant à la stratégie du Produit et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusions (normatives et sectorielles), l'engagement et les approches de vote :

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, par activité et par secteur, couvrant certains des principaux indicateurs de durabilité énumérés par le Règlement relatif à la publication d'informations.
- Engagement : L'engagement est un processus continu et ciblé visant à influencer les activités ou le comportement des entreprises. L'objectif de l'engagement peut être divisé en deux catégories : engager un émetteur à améliorer la façon dont il intègre la dimension environnementale et sociale, engager un émetteur à améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et de droits de l'homme ou d'autres questions de durabilité importantes pour la société et l'économie mondiale. Cette approche s'applique à l'ensemble des produits Amundi. En 2021, Amundi s'est engagé auprès de 1 364 entreprise.
- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse holistique de toutes les questions à long terme pouvant influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour de plus amples informations, veuillez vous référer à la Politique d'Amundi en matière de Vote. Cette approche s'applique par défaut à l'ensemble des produits Amundi. En 2021, Amundi a voté pour 4 008 entreprises.
- Suivi des controverses : Amundi a développé un système de suivi des controverses qui repose sur trois fournisseurs de données afin de suivre systématiquement les controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie par une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par les analystes ESG et par une révision périodique de son évolution. Cette approche s'applique à l'ensemble des fonds Amundi.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : Du **01/10/2021** au **30/09/2022**

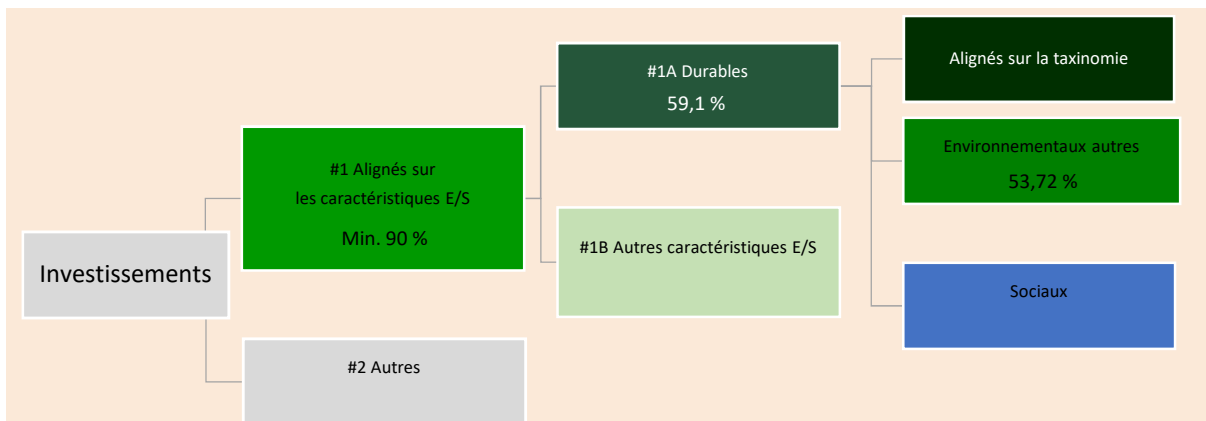
Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
BKTSM 0,875 % 07/26 EMTN	BANQUES	1,03 %	ESP
SANTAN 3,25 % 04/04/26	BANQUES	0,94 %	ESP
UNIMUS 3 % 06/27 EMTN	COMMUNICATIONS	0,76 %	NLD
BNSIM 1,625 % 10/24	REIT	0,58 %	FRA
EDPPL 1,875 % 10/25 EMTN	ÉLECTRICITÉ	0,57 %	PRT
VIEFP 0,314 % 10/23	SERVICES AUX COLLECTIVITÉS AUTRES	0,57 %	FRA
SWFP 1,125 % 05/25	CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE	0,56 %	FRA
DLR 1,125 % 04/28	REIT	0,56 %	États-Unis
SANUK VAR 08/28 EMTN	BANQUES	0,55 %	GBR
INTNED 1,625% 09/29	BANQUES	0,54 %	NLD
APAAU 2 % 3/27	GAZ NATUREL	0,54 %	AUS
BRITEL 2,125 % 09/28 EMTN	COMMUNICATIONS	0,53 %	GBR
DHR 0,75 % 09/31	BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	0,53 %	États-Unis
DB 1,625 % 01/27 EMTN	BANQUES	0,51 %	DEU
CABKSM VAR 05/28 EMTN	BANQUES	0,49 %	ESP



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

● Quelle était l'allocation des actifs ?

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



La catégorie #1 Alignés sur les caractéristiques E/S inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie #2 Autres inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** inclut les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

● Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
BANQUES	23,45 %
COMMUNICATIONS	15,11 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	11,12 %

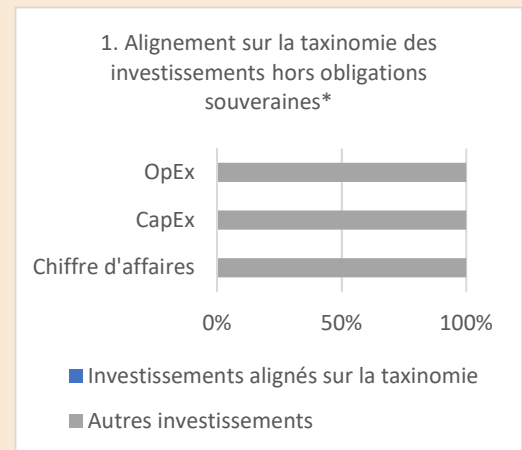
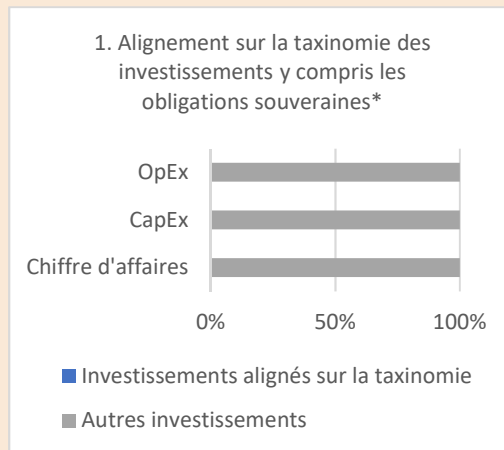
<i>FINANCE AUTRES</i>	6,50 %
<i>ÉLECTRICITÉ</i>	6,28 %
<i>CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE</i>	5,98 %
<i>REIT</i>	5,13 %
<i>BIENS D'ÉQUIPEMENT</i>	5,05 %
<i>TRANSPORTS</i>	3,79 %
<i>ASSURANCE</i>	3,43 %
<i>TECHNOLOGIE</i>	3,11 %
<i>INDUSTRIE DE BASE</i>	2,91 %
<i>SERVICES AUX COLLECTIVITÉS AUTRES</i>	1,74 %
<i>GAZ NATUREL</i>	1,73 %
<i>COURTAGE</i>	0,65 %
<i>INDUSTRIE AUTRES</i>	0,36 %
<i>SOCIÉTÉS FINANCIÈRES</i>	0,34 %
<i>ÉNERGIE</i>	0,15 %
<i>BONS DU TRÉSOR</i>	0,00 %
<i>Liquidités</i>	3,15 %



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Aucune donnée fiable relative à la taxinomie de l'UE n'était disponible durant la période.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



Données non encore disponibles

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Les activités alignées sur la taxinomie sont exprimées en pourcentage :
- du chiffre d'affaires pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- des dépenses d'investissement (CapEx) pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des dépenses d'exploitation (OpEx) pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres choses, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

- **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Aucune donnée fiable relative aux activités transitoires et habilitantes n'était disponible durant la période.

- **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Aucune donnée fiable relative à la taxinomie de l'UE n'était disponible durant les périodes de référence précédentes.



- **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

La part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie est de **53,72 %**.

Cela est dû au fait que certains émetteurs sont considérés comme des investissements durables au titre du Règlement SFDR mais contiennent une part d'activités qui ne sont pas alignées sur les normes de la taxinomie de l'UE, ou pour lesquelles aucune donnée n'est encore disponible pour pouvoir réaliser une évaluation en termes de taxinomie de l'UE.



- **Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?**

Ce produit ne s'engage pas à avoir des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?**

« #2 Autres » inclut des liquidités et des instruments non cotés détenus à des fins de gestion du risque de liquidité et de portefeuille. Il n'y avait aucune garantie environnementale ou sociale minimale en place pour ces investissements.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Les éléments contraignants dans la méthodologie de l'Indice permettent de s'assurer que les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont respectées à chaque date de rééquilibrage. La Stratégie du produit repose également sur des politiques d'exclusions systématiques (normatives et sectorielles) telles que décrites plus avant dans la Politique d'investissement responsable d'Amundi.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative.

- **En quoi l'indice de référence différait-il d'un indice de marché large ?**

iBoxx MSCI ESG EUR Corporates BBB TCA Index est un indice obligataire représentatif d'obligations notées BBB et libellées en euro, émises par des entreprises de pays développés qui suivent les règles de l'iBoxx EUR Corporates BBB TCA Index (l'« Indice parent ») et qui appliquent des critères ESG pour la sélection des titres.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Partant, les indicateurs de durabilité du Produit ont, dans l'ensemble, performé conformément à ceux de l'Indice.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Partant, les indicateurs de durabilité du Produit ont, dans l'ensemble, performé conformément à ceux de l'Indice.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Une comparaison de l'Indice répliqué par le Compartiment par rapport à son Indice parent a déjà été détaillée à la section Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales promues.

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés bénéficiaires des investissements appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste d'**activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement n'établit pas de liste d'activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dénomination du produit :
AMUNDI FLOATING RATE USD CORPORATE ESG

Identifiant d'entité juridique :
549300W6M26WPJCWRV83

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?



Oui



X

Non



Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental** : ___%



dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social** : ___%



Il **promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de **31,99 %** d'investissements durables



ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif environnemental dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE



ayant un objectif social



Il **promeut des caractéristiques E/S, mais ne réalisera pas d'investissements durables**



Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

L'objectif d'investissement du Produit est de répliquer un Indice, basé sur un Indice parent. À chaque date de rééquilibrage de l'Indice, au moins 20 % des éléments constitutifs de l'Indice parent ont été supprimés sur la base de critères de durabilité, dont une notation « ESG » (environnementale, sociale et de gouvernance).

Les indicateurs de durabilité permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit sont réalisées.

● **Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?**

Date	Indice	Score ESG moyen pondéré	Couvertu re
30/09/2022	iBoxx MSCI ESG USD FRN Investment Grade Corporates TCA EUR Hedged TRI	7,4	100 %
30/09/2022	iBoxx USD FRN Broad Investment Grade Corporates TCA	7,0	98 %

● **... et par rapport aux périodes précédentes ?**

Les indicateurs de durabilité ci-dessus n'ont pas été comparés à d'autres indicateurs précédents durant les périodes précédentes dans la mesure où la réglementation n'était pas encore en vigueur

● **Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entend partiellement réaliser, et comment l'investissement durable a-t-il contribué à ces objectifs ?**

Les objectifs des investissements durables étaient d'investir dans des entreprises cherchant à respecter deux critères :

1. Suivre les meilleures pratiques environnementales et sociales ; et
2. Éviter de fabriquer des produits ou de fournir des services causant un préjudice à l'environnement et à la société.

Au niveau de l'entreprise dans laquelle le Produit investit, cela veut dire qu'elle doit être une « entreprise la plus performante » au sein de ce secteur d'activité par rapport à l'un de ses facteurs environnementaux ou sociaux importants au moins. La définition d'entreprise « la plus performante » s'appuie sur une méthodologie ESG propre à Amundi, qui vise à mesurer la performance ESG d'une entreprise.

Pour être considérée comme « la plus performante », une entreprise doit obtenir la meilleure note parmi les trois premiers (A, B ou C, sur une échelle de notation allant de A à G) de son secteur, sur au moins un facteur environnemental ou social important. Des facteurs environnementaux et sociaux importants sont identifiés au niveau du secteur. L'identification de ces facteurs est basée sur le cadre d'analyse ESG d'Amundi qui combine des données extra-financières et une analyse qualitative des thèmes sectoriels et de durabilité associés. Les facteurs identifiés comme importants apportent une contribution de plus de 10 % au score ESG global.

Amundi considère le second critère comme respecté si l'entreprise n'a pas d'exposition significative à des activités non compatibles avec ces critères (par exemple le tabac, les armes, les jeux de hasard, le charbon, l'aviation, la production de viande, la fabrication d'engrais et de pesticides, la production de plastique à usage unique).

Les principales incidences négatives correspondent aux incidences négatives les plus significatives des décisions d'investissement sur les facteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

- ***Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a partiellement réalisés n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?***

Pour s'assurer que les investissements durables ne causent pas de préjudice important (principe du « DNSH », ou « Do Not Significant Harm »), Amundi utilise deux filtres :

Le premier filtre « DNSH » repose sur le suivi d'indicateurs obligatoires des Principales Incidences Négatives, où les données solides sont disponibles via une combinaison d'indicateurs et de seuils ou règles spécifiques :

- Avoir une intensité carbone qui n'appartient pas au dernier décile des entreprises du secteur (ne concerne que les secteurs à forte intensité)
- Avoir une diversité au sein du Conseil d'administration qui n'appartient pas au dernier décile des entreprises du secteur
- Être exempt de toute controverse en matière de conditions de travail et de droits de l'homme
- Être exempt de toute controverse en matière de biodiversité et de pollution

Amundi prend déjà en compte des Principales incidences négatives spécifiques dans sa politique d'exclusions dans le cadre de sa Politique d'investissement responsable. Ces exclusions, qui s'appliquent en plus des filtrages détaillés ci-dessus, couvrent les sujets suivants : exclusions sur les armes controversées, les violations des principes du Pacte mondial des Nations Unies, le charbon et le tabac.

Au-delà des facteurs de durabilité spécifiques couverts par le premier filtre, Amundi a défini un second filtre afin de vérifier que l'entreprise n'aligne pas de mauvaises performances environnementales ou sociales globales par rapport aux autres entreprises de son secteur.

- ***Comment les indicateurs concernant les incidences négatives sur les facteurs de durabilité ont-ils été pris en considération ?***

Le premier filtre « DNSH » repose sur le suivi d'indicateurs obligatoires des Principales Incidences Négatives, où les données solides sont disponibles via une combinaison d'indicateurs et de seuils ou règles spécifiques comme décrit ci-dessus.

- ***Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :***

Oui, les principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et les principes directeurs des Nations Unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme sont intégrés dans notre méthodologie de notation ESG. Notre outil de notation ESG propre évalue les émetteurs en utilisant les données disponibles auprès de nos fournisseurs de données. Par exemple, le modèle comporte un critère dédié appelé « Implication communautaire et droits de l'homme » qui est appliqué à tous les secteurs en plus d'autres critères liés aux droits de l'homme, notamment les chaînes d'approvisionnement socialement responsables, les conditions de travail et les relations professionnelles. En outre, nous assurons un suivi des controverses sur une base trimestrielle au minimum, qui inclut des entreprises identifiées pour violations des droits

de l'homme. Lorsque des controverses surviennent, les analystes évaluent la situation et appliquent un score à la controverse (en utilisant notre propre méthodologie de notation) et déterminent la meilleure marche à suivre. Les scores de controverse sont mis à jour tous les trimestres pour suivre la tendance et les efforts de remédiation.

La taxinomie de l'UE établit un principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » en vertu duquel les investissements alignés sur la taxinomie ne devraient pas causer de préjudice important aux objectifs de la taxinomie de l'UE et qui s'accompagne de critères spécifiques de l'UE.

Le principe consistant à « ne pas causer de préjudice important » s'applique uniquement aux investissements sous-jacents au produit financier qui prennent en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. Les investissements sous-jacents à la portion restante de ce produit financier ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental.

Tout autre investissement durable ne doit pas non plus causer de préjudice important aux objectifs environnementaux ou sociaux.



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

Amundi prend en compte tous les indicateurs obligatoires des Principales incidences négatives s'appliquant à la stratégie du Produit et s'appuie sur une combinaison de politiques d'exclusions (normatives et sectorielles), l'engagement et les approches de vote :

- Exclusion : Amundi a défini des règles d'exclusion normatives, par activité et par secteur, couvrant certains des principaux indicateurs de durabilité énumérés par le Règlement relatif à la publication d'informations.
- Engagement : L'engagement est un processus continu et ciblé visant à influencer les activités ou le comportement des entreprises. L'objectif de l'engagement peut être divisé en deux catégories : engager un émetteur à améliorer la façon dont il intègre la dimension environnementale et sociale, engager un émetteur à améliorer son impact sur les questions environnementales, sociales et de droits de l'homme ou d'autres questions de durabilité importantes pour la société et l'économie mondiale. Cette approche s'applique à l'ensemble des produits Amundi. En 2021, Amundi s'est engagé auprès de 1 364 entreprise.
- Vote : La politique de vote d'Amundi répond à une analyse holistique de toutes les questions à long terme pouvant influencer la création de valeur, y compris les questions ESG importantes. Pour de plus amples informations, veuillez vous référer à la Politique d'Amundi en matière de Vote. Cette approche s'applique par défaut à l'ensemble des produits Amundi. En 2021, Amundi a voté pour 4 008 entreprises.
- Suivi des controverses : Amundi a développé un système de suivi des controverses qui repose sur trois fournisseurs de données afin de suivre systématiquement les controverses et leur niveau de gravité. Cette approche quantitative est ensuite enrichie par une évaluation approfondie de chaque controverse grave, menée par les analystes ESG et par une révision périodique de son évolution. Cette approche s'applique à l'ensemble des fonds Amundi.



Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

La liste comprend les investissements constituant la plus grande proportion d'investissements du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : Du 01/10/2021 au 30/09/2022

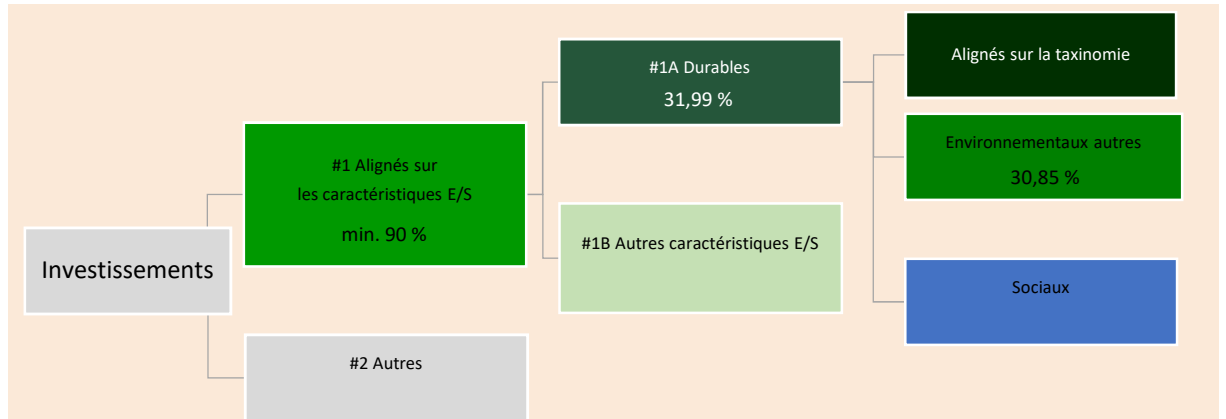
Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
MS 2,28178% 10/23	BANQUES	1,39 %	États-Unis
HSBC FRN 05/24	BANQUES	1,32 %	GBR
VZ FRN 05/25	COMMUNICATIONS	1,09 %	États-Unis
MUFG FRN 07/23	BANQUES	1,08 %	JPN
AT&T FRN 06/24	COMMUNICATIONS	0,99 %	États-Unis
CBAAU FRN 07/25 REGS	BANQUES	0,97 %	AUS
BACR FRN 05/24	BANQUES	0,97 %	GBR
TFC FRN 01/24 BKNT	BANQUES	0,96 %	États-Unis
BAC FRN 02/26 MTN	BANQUES	0,95 %	États-Unis
BNS FRN 09/23 *	BANQUES	0,94 %	CAN
BMO FRN 03/23 MTN	BANQUES	0,90 %	CAN
MS FRN 5/24	BANQUES	0,82 %	États-Unis
SCHW FRN 03/24	COURTAGE	0,81 %	États-Unis
CM FRN 03/23 *	BANQUES	0,81 %	CAN
ATO FRN 03/23	GAZ NATUREL	0,74 %	États-Unis



Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Quelle était l'allocation des actifs ?

L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- la sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables sur le plan environnemental et social.
- la sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** inclut les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Secteur	% d'actifs
BANQUES	69,42 %
CONSOMMATION DISCRÉTIONNAIRE	7,49 %
BIENS DE CONSOMMATION DE BASE	4,17 %
BIENS D'ÉQUIPEMENT	3,99 %

<i>COMMUNICATIONS</i>	<i>3,80 %</i>
<i>ASSURANCE</i>	<i>1,86 %</i>
<i>ÉLECTRICITÉ</i>	<i>1,44 %</i>
<i>COURTAGE</i>	<i>1,39 %</i>
<i>GAZ NATUREL</i>	<i>1,39 %</i>
<i>SOCIÉTÉS FINANCIÈRES</i>	<i>0,69 %</i>
<i>TECHNOLOGIE</i>	<i>0,67 %</i>
<i>ÉNERGIE</i>	<i>0,63 %</i>
<i>TRANSPORTS</i>	<i>0,31 %</i>
<i>INDUSTRIE DE BASE</i>	<i>0,22 %</i>
<i>Autres</i>	<i>0,00 %</i>
<i>Liquidités</i>	<i>2,52 %</i>

Les **activités alignées sur la taxinomie** sont exprimées en pourcentage :

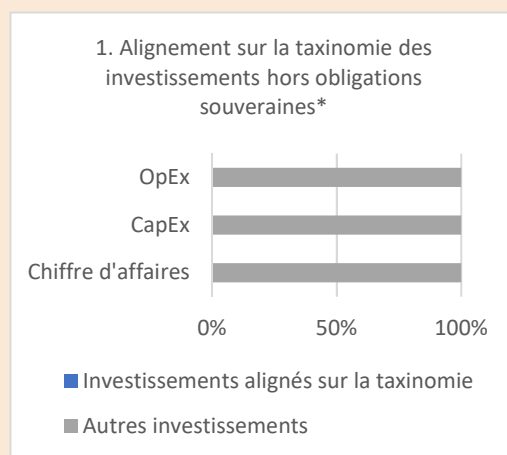
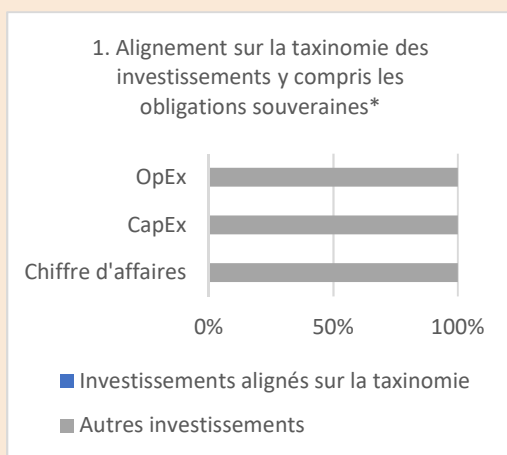
- du **chiffre d'affaires** pour refléter la part des revenus provenant des activités vertes des sociétés bénéficiaires des investissements ;
- des **dépenses d'investissement (CapEx)** pour montrer les investissements verts réalisés par les sociétés bénéficiaires des investissements, pour une transition vers une économie verte par exemple ;
- des **dépenses d'exploitation (OpEx)** pour refléter les activités opérationnelles vertes des sociétés bénéficiaires des investissements.



Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Aucune donnée fiable relative à la taxinomie de l'UE n'était disponible durant la période.

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous les investissements du produit financier, y compris les obligations souveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



Données non encore disponibles

* Aux fins de ces graphiques, les « obligations souveraines » comprennent toutes les expositions souveraines.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités de contribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres choses, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.



représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** applicables aux activités économiques durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE.

- **Quelle était la part des investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?**

Aucune donnée fiable relative aux activités transitoires et habilitantes n'était disponible durant la période.

- **Où se situe le pourcentage d'investissements alignés sur la taxinomie de l'UE par rapport aux périodes de référence précédentes ?**

Aucune donnée fiable relative à la taxinomie de l'UE n'était disponible durant les périodes de référence précédentes.



- **Quelle était la part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie de l'UE ?**

La part d'investissements durables ayant un objectif environnemental non alignés sur la taxinomie est de **30,85 %**.

Cela est dû au fait que certains émetteurs sont considérés comme des investissements durables au titre du Règlement SFDR mais contiennent une part d'activités qui ne sont pas alignées sur les normes de la taxinomie de l'UE, ou pour lesquelles aucune donnée n'est encore disponible pour pouvoir réaliser une évaluation en termes de taxinomie de l'UE.



- **Quelle était la part d'investissements durables sur le plan social ?**

Ce produit ne s'engage pas à avoir des investissements durables sur le plan social.



- **Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité et existait-il des garanties environnementales ou sociales minimales ?**

« #2 Autres » inclut des liquidités et des instruments non cotés détenus à des fins de gestion du risque de liquidité et de portefeuille. Il n'y avait aucune garantie environnementale ou sociale minimale en place pour ces investissements.



Quelles mesures ont été prises pour respecter les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Les éléments contraignants dans la méthodologie de l'Indice permettent de s'assurer que les caractéristiques environnementales et/ou sociales sont respectées à chaque date de rééquilibrage. La Stratégie du produit repose également sur des politiques d'exclusions systématiques (normatives et sectorielles) telles que décrites plus avant dans la Politique d'investissement responsable d'Amundi.



Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative.

- **En quoi l'indice de référence différait-il d'un indice de marché large ?**

iBoxx MSCI ESG USD FRN Investment Grade Corporates TCA Index est un indice obligataire représentatif d'obligations à taux flottant (FRN) de type « investment grade » libellées en dollar, émises par des entreprises de pays développés qui suivent les règles de l'iBoxx USD FRN Investment Grade Corporates TCA Index (l'« Indice parent ») et appliquent des critères ESG pour la sélection des titres.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?**

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Partant, les indicateurs de durabilité du Produit ont, dans l'ensemble, performé conformément à ceux de l'Indice.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?**

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Partant, les indicateurs de durabilité du Produit ont, dans l'ensemble, performé conformément à ceux de l'Indice.

- **Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?**

Ce produit fait l'objet d'une gestion passive. Sa stratégie d'investissement consiste à répliquer l'Indice tout en minimisant l'erreur de réplication y relative. Une comparaison de l'Indice répliqué par le Compartiment par rapport à son Indice parent a déjà été détaillée à la section Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales promues.

