



28/09/2018

Fonds de droit français

**GROUPAMA
CONVERTIBLES**

RAPPORT SEMESTRIEL

- **ETAT DU PATRIMOINE EN EUR**

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier.	475 082 562,98
b) Avoirs bancaires	15 873 934,58
c) Autres actifs détenus par l'OPC	97 352 458,79
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	588 308 956,35
e) Passif	-63 842 536,43
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	524 466 419,92

* Les montants sont signés

- **NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART**

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
GR.CONVERTIBLES IC	C	56 052 472,15	40 325,7833	1 389,99
GROUPAMA CONVERTIBLES M	C	110 731 807,25	703 250,2570	157,45
GROUPAMA CONVERTIBLES N	C	48 282 013,43	78 200,9751	617,40
GROUPAMA CONVERTIBLES O	C	141,22	0,0100	14 122,00
GROUPAMA CONVERTIBLES G	C/D	62 296 745,27	5 229,4160	11 912,75
GROUPAMA CONVERTIBLES ID	D	247 103 240,60	80 533,3868	3 068,33

• **ELEMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES**

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
<p>A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-I du code monétaire et financier.</p> <p>Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.</p>	82,24	73,32
<p>C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.</p>	8,34	7,44
<p>D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.</p>		
<p>E) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.</p>		

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

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

• **RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE**

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Dollar us	USD	26 000 686,80	4,96	4,42
Euro	EUR	426 605 923,08	81,34	72,51
Franc suisse	CHF	20 844 267,80	3,97	3,54
Livre sterling	GBP	1 631 685,30	0,31	0,28
TOTAL		475 082 562,98	90,58	80,75

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

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

- **RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR**

Pays	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
France	27,87	24,85
Allemagne	25,10	22,37
Pays-bas	8,13	7,25
Italie	4,97	4,43
Suisse	3,97	3,54
Luxembourg	3,84	3,42
Espagne	3,62	3,23
Belgique	3,15	2,81
Etats unis americque	2,42	2,16
Autriche	1,96	1,74
Royaume uni	1,92	1,71
Emirats arabes unis	1,12	0,99
Hongrie	0,88	0,79
Jersey	0,44	0,39
Suede	0,40	0,36
Finlande	0,40	0,36
Mexique	0,39	0,35
TOTAL	90,58	80,75

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

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

• **RÉPARTITION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE**

Nature d'actifs	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Organismes de placement collectif		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays		
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE		
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés		
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés		
Autres organismes non européens		
Autres		
TOTAL		

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

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

• **MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE EN EUR**

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-I du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	131 827 982,32	97 421 404,32
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	23 007 778,73	6 902 275,30
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.		

• **DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE**

	Part	Montant net unitaire €	Crédit d'impôt (1) €	Montant brut unitaire (2) €
Dividendes versés				
25/07/2018	GROUPAMA CONVERTIBLES G	95,74	0,00	95,74
25/07/2018	GROUPAMA CONVERTIBLES ID	14,13		14,13
Dividendes à verser				
	GROUPAMA CONVERTIBLES G			
	GROUPAMA CONVERTIBLES ID			

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

(2) Le montant brut unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

• **INFORMATIONS DIVERSES**

Etablissement dépositaire : Caceis Bank - 1-3 place Valhubert - 75013 - Paris

Le relevé Périodicité Semestrielle détaillé de l'actif est disponible dans un délai de huit semaines à compter de la fin de la période. Il peut être transmis sur simple demande auprès de la société de gestion :

Groupama Asset Management - 25 rue de la Ville l'Evêque - 75008 - Paris

- **TRANSPARENCE DES OPERATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA REUTILISATION DES INSTRUMENTS FINANCIERS – REGLEMENT SFTR – en devise de comptabilité de l'OPC (EUR)**

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

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 28/09/2018 EN EUR**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Actions et valeurs assimilées				
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
PAYS-BAS				
KONINKLIJKE KPN NV	EUR	389 524	884 998,53	0,17
TOTAL PAYS-BAS			884 998,53	0,17
TOTAL Actions & val. ass. ng. sur marchés régl. ou ass.			884 998,53	0,17
TOTAL Actions et valeurs assimilées			884 998,53	0,17
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
ADIDAS AG 0.05% 12-09-23 CV	EUR	9 400 000	10 049 327,53	1,92
ADLE REA 4.75% 08-04-20 EMTN	EUR	475 000	497 001,21	0,09
BASF 0.925% 09-03-23 EMTN	USD	4 000 000	3 233 959,44	0,62
BAYER 0.05% 15-06-20	EUR	17 400 000	18 876 900,08	3,60
DEUTSCHE POST AG 0.05% 30-06-25	EUR	2 200 000	2 179 829,01	0,42
DEUTSCHE WOHNEN AG 0.325% 26-07-24	EUR	19 200 000	20 745 321,21	3,96
FRESEN 0% 24/09/2019	EUR	9 000 000	11 714 490,00	2,23
FRESENIUS SE ZCP 31-01-24	EUR	7 500 000	7 580 925,00	1,45
HANI FINA DEUT ZCP 12-05-20 CV	EUR	8 900 000	8 822 659,00	1,68
LEG IMMOBILIEN AG 0.5% 01/07/2021 CV	EUR	3 500 000	6 756 017,49	1,29
LEG IMMOBILIEN AG 0.875% 01-09-25	EUR	2 700 000	2 981 986,14	0,57
MTU AERO ENGI 0.125% 17-05-23	EUR	3 000 000	4 821 157,81	0,92
RAG STIFTUNG ZCP 02-10-24 CV	EUR	8 400 000	8 567 496,00	1,63
RAG STIFTUNG ZCP 16-03-23	EUR	2 700 000	2 873 070,00	0,55
RAG STIFTUNG 0% 31-12-18 CV	EUR	5 500 000	5 514 245,00	1,05
SCHAEFFLER VERWALTUNG ZWEI GMBH 3.25% 15-09-23	EUR	1 600 000	1 666 684,89	0,32
SGL CARBON AG 3.5% 30-09-20	EUR	1 800 000	1 847 902,15	0,35
SYMRISE AG 0.2375% 20-06-24	EUR	6 600 000	7 695 842,30	1,47
TAG TEGERNSEE IMMOBILIEN 0.625% 01-09-22	EUR	4 300 000	5 207 322,45	0,99
TOTAL ALLEMAGNE			131 632 136,71	25,11
AUTRICHE				
AUSTRIAMICROSYSTEMS AG ZCP 05-03-25	EUR	4 000 000	3 055 720,00	0,58
CA IMMOBILIEN ANLAGEN 1.875% 26-03-26	EUR	2 529 000	2 510 963,73	0,48
IMMOFINANZ AG 2.0% 24-01-24	EUR	4 000 000	4 688 737,39	0,90
TOTAL AUTRICHE			10 255 421,12	1,96
BELGIQUE				
BEKAERT ZCP 09-06-21	EUR	4 500 000	3 969 630,00	0,76
COFINIMMO SA 0.1875% 15-09-21	EUR	76 904	11 058 179,97	2,11

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 28/09/2018 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ECONOCOM GROUP 0.5% 06-03-23	EUR	225 000	1 481 400,00	0,28
TOTAL BELGIQUE			16 509 209,97	3,15
EMIRATS ARABES UNIS				
AABAR 0.5% 27-03-20 EMTN	EUR	6 300 000	5 850 363,08	1,12
TOTAL EMIRATS ARABES UNIS			5 850 363,08	1,12
ESPAGNE				
CELLNEX TELECOM 1.5% 16-01-26 CV	EUR	7 000 000	7 368 946,67	1,40
INDR SIST 1.25% 07-10-23	EUR	2 000 000	2 018 918,47	0,38
INTL CONS AIR 0.25% 17-11-20	EUR	6 000 000	5 910 465,00	1,13
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROU 0.625% 17-11-22	EUR	3 800 000	3 707 218,25	0,71
TOTAL ESPAGNE			19 005 548,39	3,62
ETATS UNIS AMERIQUE				
FORD MOTOR CREDIT E3R+0.37% 01-12-21	EUR	4 400 000	4 317 278,53	0,82
GLENORE FU LLC ZCP 27-03-25 CV	USD	4 400 000	3 424 537,24	0,65
MORGAN STANLEY FINANCE LLC ZCP 17-12-21 CV	EUR	5 000 000	4 962 500,00	0,95
TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE			12 704 315,77	2,42
FINLANDE				
OUTOKUMPU OYJ 3.25% 26-02-20	EUR	2 000 000	2 094 815,33	0,40
TOTAL FINLANDE			2 094 815,33	0,40
FRANCE				
ARCHER OBLIGATIONS ZCP 31-03-23	EUR	4 500 000	5 679 540,00	1,08
AXASA 5 1/2 07/22/49	USD	300 000	249 565,50	0,05
BIM 2.5% 13-11-20 CV	EUR	150 000	3 456 900,00	0,66
CA ZCP 03-10-19	EUR	63 500	4 887 595,00	0,93
CIE GEN DES ETS MICHELIN ZCP 10-11-23	USD	4 400 000	3 279 524,75	0,63
ELIS EX HOLDELIS ZCP 06-10-23	EUR	190 000	6 249 670,00	1,19
FRAN E3R+0.57% 28-06-21	EUR	3 300 000	3 310 718,03	0,63
KORIAN SA 2.5% PERP CV	EUR	103 062	4 236 981,88	0,81
NEX 0.125% 01-01-23 CV	EUR	70 000	4 712 680,00	0,90
NEXANS 2.5% 01/01/19 CV	EUR	46 000	3 426 862,00	0,65
NEXITY 0.25% 02-03-25 CV	EUR	85 000	5 739 880,00	1,09
ORPAR ZCP 20-06-24 CV	EUR	35	3 662 015,00	0,70
PIERRE ET VACANCES 2.0% 01-04-23	EUR	34 751	1 933 893,15	0,37
PSA BANQUE FRANCE 0.5% 17-01-20	EUR	2 400 000	2 422 762,19	0,46
RALLYE 1% 02/10/20	EUR	43 055	4 582 558,93	0,87
REMY COIN 0.125% 07-09-26	EUR	59 273	7 702 348,53	1,47
RENAULT CREDIT INTL BANQUE E3R+0.45% 08-07-20	EUR	5 000 000	5 014 322,92	0,96
REXEL 3.5% 15-06-23	EUR	2 500 000	2 616 981,94	0,50
SAFRAN SA ZCP 21-06-23 CV	EUR	81 578	12 605 269,40	2,41

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 28/09/2018 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SAFRAN ZCP 31-12-20 CV	EUR	70 000	8 466 780,00	1,61
SUEZ ZCP 27-02-20 CV	EUR	240 000	4 410 480,00	0,84
UBISOFT ZCP 27-09-21	EUR	91 862	8 850 719,98	1,69
VALE ELEC ET ZCP 16-06-21 EMTN	USD	3 200 000	2 581 076,19	0,49
VALLOUREC 4.125% 04-10-22 CV	EUR	290 276	2 105 371,83	0,40
VEOL ENVI ZCP 15-03-21	EUR	246 700	7 356 594,00	1,40
WEND ZCP 31-07-19 EMTN	EUR	90 210	4 694 077,35	0,90
TOTAL FRANCE			124 235 168,57	23,69
HONGRIE				
HUSTHO 3 3/8 04/02/19 CV	EUR	4 500 000	4 634 330,16	0,88
TOTAL HONGRIE			4 634 330,16	0,88
ITALIE				
BENI STABILI 0.875% 31-01-21	EUR	3 000 000	3 082 493,89	0,59
BUZZI UNICEM SPA 1.375% 17/07/2019	EUR	1 900 000	2 225 046,37	0,42
PRYSMIAN ZCP 17-01-22	EUR	6 000 000	5 886 420,00	1,12
SNAM ZCP 20-03-22	EUR	6 000 000	5 935 680,00	1,13
TELECOM ITALIA SPA EX OLIVETTI 1.125% 26-03-22	EUR	9 300 000	8 933 268,12	1,71
TOTAL ITALIE			26 062 908,38	4,97
JERSEY				
TULL OIL J 6.625% 12-07-21 CV	USD	2 000 000	2 282 225,09	0,44
TOTAL JERSEY			2 282 225,09	0,44
LUXEMBOURG				
ACTAVIS FUNDING SCS E3R+0.35% 01-06-19	EUR	6 100 000	6 107 284,08	1,16
CITI GLO 0.5% 04-08-23 EMTN	EUR	4 900 000	5 238 715,22	1,00
GRAN CITY PRO 0.25% 02-03-22	EUR	8 000 000	8 797 337,46	1,68
TOTAL LUXEMBOURG			20 143 336,76	3,84
MEXIQUE				
AMERICA MOVIL SAB DE ZCP 28-05-20	EUR	2 100 000	2 068 857,00	0,39
TOTAL MEXIQUE			2 068 857,00	0,39
PAYS-BAS				
AIRBUS GRO ZCP 14-06-21 EMTN	EUR	13 400 000	16 577 542,00	3,16
BAYER CAP 5.625% 22-11-19	EUR	2 500 000	2 332 130,48	0,44
FERRARI NV 0.25% 16-01-21	EUR	1 000 000	993 373,97	0,19
IBERDROLA INTERNATIONAL BV ZCP 11-11-22 CV	EUR	2 700 000	2 737 341,00	0,52
PACCAR FINANCIAL EUROPE BV E3R+0.45% 18-05-21	EUR	1 000 000	1 005 846,47	0,19
QGEN 0 7/8 03/19/21	USD	5 200 000	6 071 468,84	1,16
SALZ FINA BV ZCP 05-06-22	EUR	1 100 000	1 196 866,00	0,23
STMICROELECTRONICS NV ZCP 03-07-22	USD	5 200 000	4 878 329,75	0,93

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 28/09/2018 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ZIGGO BOND COMPANY BV 7.125% 15-05-24	EUR	5 438 000	5 960 779,86	1,14
TOTAL PAYS-BAS			41 753 678,37	7,96
ROYAUME UNI				
EC FINANCE 2.375% 15-11-22	EUR	1 400 000	1 413 619,47	0,27
GSK CAP E3R+0.2% 21-05-20 EMTN	EUR	7 000 000	7 023 660,00	1,34
J SAINSBURY PLC 6.5% PERP	GBP	1 349 000	1 631 685,30	0,31
TOTAL ROYAUME UNI			10 068 964,77	1,92
SUEDE				
SCANIA CV AB E3R+0.35% 06-09-19	EUR	2 100 000	2 103 932,02	0,40
TOTAL SUEDE			2 103 932,02	0,40
SUISSE				
IMPLENIA 0.5% 30-06-22	CHF	2 000 000	1 771 218,16	0,34
SIKA AG 0.15% 05-06-25 CV	CHF	15 720 000	14 744 246,00	2,81
SWIS PRIM SIT 0.25% 16-06-23	CHF	500 000	429 168,45	0,08
SWISS PRIME SITE AG 0.325% 16-01-25	CHF	4 600 000	3 899 635,19	0,74
TOTAL SUISSE			20 844 267,80	3,97
TOTAL Obligations & val. ass. ng. sur mar. régl. ou ass.			452 249 479,29	86,24
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			452 249 479,29	86,24
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
FRANCE				
CASINO GUICHARD PERRACHON 241018 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 998 333,76	1,91
FNAC DARTY SA 291018 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 000 000,00	1,90
VALLOUREC 261018 FIX 0.17	EUR	1 950 000	1 949 751,40	0,37
TOTAL FRANCE			21 948 085,16	4,18
TOTAL Titres de créances négo. sur marchés régl. ou ass.			21 948 085,16	4,18
TOTAL Titres de créances			21 948 085,16	4,18
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
GROUPAMA EONIA IC	EUR	160,506	34 403 473,99	6,56
TOTAL FRANCE			34 403 473,99	6,56
LUXEMBOURG				
G FUND ABS RETURN BDS IC	EUR	3 000	2 988 990,00	0,57
TOTAL LUXEMBOURG			2 988 990,00	0,57
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			37 392 463,99	7,13
TOTAL Organismes de placement collectif			37 392 463,99	7,13

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 28/09/2018 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Instruments financiers à terme				
Engagements à terme ferme				
Engagements à terme ferme sur marché réglementé ou assimilé				
EUR XEUR EUFF S 1218	EUR	-20	10 730,00	
EUR XEUR FESX D 1218	EUR	-250	23 500,00	
EUR XEUR FOAT E 1218	EUR	-110	166 100,00	0,04
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé			200 330,00	0,04
TOTAL Engagements à terme fermes			200 330,00	0,04
Engagements à terme conditionnel				
Engagements à terme conditionnel sur marché réglementé ou assimilé				
AIRBUS SE 06/2020 CALL 110	EUR	750	854 250,00	0,16
AIRBUS SE 12/2018 CALL 112	EUR	500	180 500,00	0,03
AIRBUS SE 12/2018 CALL 120	EUR	-750	-108 750,00	-0,02
AIRBUS SE 12/2018 PUT 90	EUR	-500	-32 500,00	-0,01
DEUTSCHE POST NAMEN 12/2021 CALL 48	EUR	4 705	150 560,00	0,03
DJ EURO STOXX 50 10/2018 CALL 3500	EUR	800	36 800,00	0,01
DJ EURO STOXX 50 11/2018 PUT 2850	EUR	445	15 130,00	
DJ EURO STOXX 50 11/2018 PUT 3100	EUR	-890	-93 450,00	-0,02
DJ EURO STOXX 50 11/2018 PUT 3325	EUR	445	181 115,00	0,03
DJ EURO STOXX 50 12/2018 PUT 2950	EUR	-565	-70 060,00	-0,01
EUR/USD CME 01/2019 CALL 1,21	USD	25	15 335,77	
EUR/USD CME 01/2019 PUT 1,12	USD	-25	-8 071,46	
IBERDROLA S.A. 06/2019 CALL 7	EUR	4 480	40 320,00	0,01
IBERDROLA S.A. 12/2020 CALL 7	EUR	22 000	440 000,00	0,08
LVMH 12/2018 CALL 300	EUR	80	119 920,00	0,02
LVMH 12/2018 CALL 320	EUR	-80	-49 120,00	-0,01
LVMH 12/2018 PUT 240	EUR	-80	-12 480,00	
ORANGE 12/2018 CALL 16	EUR	4 000	4 000,00	
PEUGEOT 12/2019 CALL 20	EUR	2 270	1 016 960,00	0,20
QIAGEN 12/2018 CALL 40	EUR	-1 270	-10 160,00	
QIAGEN 12/2018 PUT 26	EUR	1 270	11 430,00	
ROYA DUTC SHEL PLC 12/2020 CALL 30	EUR	2 900	516 200,00	0,10
SAFRAN 12/2018 CALL 130	EUR	-700	-182 700,00	-0,03
SAFRAN 12/2018 PUT 105	EUR	-700	-98 000,00	-0,02
SAFRAN 12/2018 PUT 115	EUR	700	269 500,00	0,05
TECHNIPFMC LIMITED 06/2019 CALL 28	EUR	2 150	522 450,00	0,10
TOTAL 12/2018 CALL 56	EUR	270	49 140,00	0,01
TOTAL 12/2018 PUT 54	EUR	-270	-39 690,00	-0,01

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 28/09/2018 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TOTAL 12/2019 CALL 52	EUR	1 500	871 500,00	0,17
VINCI (EX SGE) 12/2020 CALL 95	EUR	1 068	423 996,00	0,08
TOTAL Engagements à terme conditionnels sur marché réglementé			5 014 125,31	0,95
TOTAL Engagements à terme conditionnels			5 014 125,31	0,95
TOTAL Instruments financiers à terme			5 214 455,31	0,99
Appel de marge				
Appels de marges JP. Morgan en euro	EUR	-200 331,99	-200 331,99	-0,04
TOTAL Appel de marge			-200 331,99	-0,04
Créances			54 040 558,03	10,30
Dettes			-62 932 681,44	-12,00
Comptes financiers			15 869 393,04	3,03
Actif net			524 466 419,92	100,00