

TRUSTEAM OPTIMUM

DOCUMENT D'INFORMATION PERIODICITE SEMESTRIELLE AU 30/12/2016

FORME JURIDIQUE DE L'OPC

FCP Général

CLASSIFICATION

Diversifié

AFFECTATION DES RESULTATS

Résultat capitalisable & distribuable

ETAT DU PATRIMOINE

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Les titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier	173 701 740,42
b) Avoirs bancaires	22 579 360,28
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	20 226 669,29
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	216 507 769,99
e) Passif	-353 868,99
f) Valeur nette d'inventaire	216 153 901,00

* Les montants sont signés

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

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur liquidative
A1 TRUSTEAM OPT.A 3D	Capitalisable	111 180 369,07	712 289,793	156,09
B1 TRUSTEAM OPT.B 3D	Capitalisable	104 191 599,39	629 115,824	165,62
D3 TRUSTEAM OPTIM.3D	Distribuable	781 932,54	4 332,24	180,49

ELEMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres :	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1	80,36	80,23
b) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	0,00	0,00
c) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières	0,00	0,00
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Les autres actifs	9,34	9,32

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

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
			Actif net	Total des actifs
SPAIN 0%081217	EUR	5 017 250,00	2,34	2,31
SPAIN 0%070417	EUR	5 011 800,00	2,32	2,31
ONTEX GROU 4,75%21	EUR	3 662 064,95	1,69	1,69
ABN AMRO 7,125%22	EUR	3 416 509,70	1,58	1,58
PRYSMIAN 2,5%22	EUR	3 330 260,64	1,54	1,54
BOLLORE 2,875%0721	EUR	3 212 175,62	1,49	1,48
MERLIN ENT 2,75%22	EUR	3 153 630,00	1,46	1,46
UCB 1,875%020422	EUR	3 148 764,25	1,46	1,45
MEDIASET 5,125%19	EUR	2 915 128,16	1,35	1,35
FAURECIA 3,125%22	EUR	2 895 657,20	1,34	1,34
CO.RABOBK 6,875%20	EUR	2 841 266,56	1,31	1,31
WIND ACQUISIT 4%20	EUR	2 807 532,00	1,30	1,30
JEFFERIES 2,375%20	EUR	2 696 450,92	1,25	1,25
LAGARDERE 2%190919	EUR	2 692 087,37	1,25	1,24
EUROFINS S 2,25%22	EUR	2 616 388,48	1,21	1,21
LDBK 5,875%19	EUR	2 611 644,01	1,21	1,21
ELIS 3%300422	EUR	2 571 698,25	1,19	1,19
CELLNEX T 3,125%22	EUR	2 571 452,71	1,19	1,19
INTESA 5,15%160720	EUR	2 534 169,14	1,17	1,17
ERSTE GRO 7,125%22	EUR	2 531 444,93	1,17	1,17
SALINI IMP 3,75%21	EUR	2 509 196,78	1,16	1,16
PICARD BON 7,75%20	EUR	2 430 680,00	1,12	1,12
CASINO GU.4,726%21	EUR	2 406 994,36	1,11	1,11
GAZ CAPIT 3,755%17	EUR	2 364 965,92	1,09	1,09
BRF 2,75%030622	EUR	2 297 709,23	1,06	1,06
SAFILO 1,25%19 CV	EUR	2 281 920,66	1,06	1,05
EP ENERGY 4,375%18	EUR	2 115 669,44	0,98	0,98
ADLER 4,75%20 RATE	EUR	2 101 932,14	0,97	0,97
BILFINGER 2,375%19	EUR	2 073 693,70	0,96	0,96
VALLOUREC 3,25%19	EUR	2 059 324,66	0,95	0,95
CR.AGR.4,05%20 TSR	EUR	2 020 780,00	0,93	0,93
INTL GAMINDX RTG20	EUR	1 832 594,63	0,85	0,85
MACQUARIE BK 6%20	EUR	1 797 248,84	0,83	0,83
NEOPOST 2,5%230621	EUR	1 775 749,81	0,82	0,82
ATRIUM EURO R 4%20	EUR	1 760 635,03	0,81	0,81
AMORIM 3,375%18 CV	EUR	1 710 870,90	0,79	0,79
VILMORIN 2,375%21	EUR	1 699 448,33	0,79	0,78
METROVACESA INDX22	EUR	1 688 096,66	0,78	0,78
CAMPOFRIO 3,375%22	EUR	1 681 864,00	0,78	0,78
INTL.C.AIR 0,25%20	EUR	1 662 074,25	0,77	0,77
GALP ENER.4,125%19	EUR	1 661 205,74	0,77	0,77
ARCELORMITTAL 3%21	EUR	1 612 334,38	0,75	0,74
STD CHART 3,625%22	EUR	1 610 237,88	0,74	0,74
AUTOSTR B 2,375%20	EUR	1 592 002,19	0,74	0,74
AROUNDTOWN TV0522	EUR	1 579 597,59	0,73	0,73

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
			Actif net	Total des actifs
BCO BRASIL 3,75%18	EUR	1 565 915,75	0,72	0,72
AROUNDTOWN PR 3%21	EUR	1 543 965,66	0,71	0,71
FF GROUP1,75%19 CV	EUR	1 532 210,00	0,71	0,71
ANGLO AMER 1,5%20	EUR	1 518 605,34	0,70	0,70
LOXAM 4,875%230721	EUR	1 465 208,50	0,68	0,68
AMER.MOV.0%280520	EUR	1 458 075,00	0,67	0,67
INTESA SAN 5%0919	EUR	1 422 593,38	0,66	0,66
NATIONWIDE 6,75%20	EUR	1 412 329,43	0,65	0,65
EP ENERGY 5,875%19	EUR	1 373 625,67	0,64	0,63
BENI STABIL.3,5%19	EUR	1 354 152,05	0,63	0,63
KIRK BEAU 6,25%22	EUR	1 353 188,00	0,63	0,63
BNPP FORTIS TVPERP	EUR	1 329 323,33	0,61	0,61
DNB BK ASA 4,75%22	EUR	1 309 301,54	0,61	0,60
OUTOKUMPU 7,25%21	EUR	1 303 302,49	0,60	0,60
AMPLIFON 4,875%18	EUR	1 257 193,29	0,58	0,58
MEDIOBANCA 5%20	EUR	1 218 901,53	0,56	0,56
REXEL 3,25%150622	EUR	1 204 055,75	0,56	0,56
GALP ENERGIA 3%21	EUR	1 189 439,20	0,55	0,55
UNICREDIT TV191217	EUR	1 183 881,93	0,55	0,55
CAMPARI 2,75%20	EUR	1 180 902,29	0,55	0,55
TDC 3,75%020322	EUR	1 161 721,10	0,54	0,54
SACYR 4%0519 CV	EUR	1 144 061,04	0,53	0,53
KS 4,125%061221	EUR	1 133 114,38	0,52	0,52
FORTFIN.TV PERP.CV	EUR	1 096 774,10	0,51	0,51
ILIAD	EUR	1 095 900,00	0,51	0,51
STENA 6,125%010217	EUR	1 084 913,67	0,50	0,50
GRUPO ANT 5,125%22	EUR	1 080 547,08	0,50	0,50
DISCOVERY 2,375%22	EUR	1 078 940,68	0,50	0,50
ORIGIN ENER 2,5%20	EUR	1 073 371,51	0,50	0,50
BNDES 3,625%210119	EUR	1 068 617,21	0,49	0,49
NEOPOST TV PERP CV	EUR	1 051 240,00	0,49	0,49
BMBG BOND FIN 3%21	EUR	1 046 130,00	0,48	0,48
GALP TV180218	EUR	1 041 233,17	0,48	0,48
CRED.AGR.4%10 TSR	EUR	1 031 294,44	0,48	0,48
KON.DSM NOM.	EUR	1 031 260,80	0,48	0,48
ABN AMRO TV300617	EUR	1 000 291,00	0,46	0,46
TELECOM 1,125%22CV	EUR	978 426,66	0,45	0,45
BENI 7/8%310121 CV	EUR	963 119,24	0,45	0,44
RADIAN 4,55%20 TSR	EUR	888 688,63	0,41	0,41
SGL CARBON 3,5%20	EUR	863 518,15	0,40	0,40
UCB 4,125%040121	EUR	817 661,11	0,38	0,38
BHARTI AI 3,375%21	EUR	774 313,53	0,36	0,36
INDRA 1,25%1023 CV	EUR	761 873,58	0,35	0,35
ICAP INDX RTG 0319	EUR	751 752,25	0,35	0,35
JC DECAUX	EUR	698 250,00	0,32	0,32
CONTOURGL 5,125%21	EUR	633 175,50	0,29	0,29
ESPAGNE 0%070417	EUR	600 750,00	0,28	0,28
UCB 3,75%270320	EUR	559 371,30	0,26	0,26

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
			Actif net	Total des actifs
GVM DEB.5,75%0218	EUR	558 436,50	0,26	0,26
HAVAS 1,875%1220	EUR	521 992,81	0,24	0,24
DIR.EN.4,40%20 T.1	EUR	520 765,96	0,24	0,24
BUL ENERGY 4,25%18	EUR	517 828,49	0,24	0,24
SOCIETE GENER 1%22	EUR	502 538,08	0,23	0,23
ESPAGNE 0%170217	EUR	500 250,50	0,23	0,23
ADLER 2,5%0721 CV	EUR	476 309,40	0,22	0,22
GPE EUROTUN.REGPT	EUR	451 700,00	0,21	0,21
INDESIT COM 4,5%18	EUR	434 299,40	0,20	0,20
INDRA 1,75%18 CONV	EUR	400 940,00	0,19	0,19
RADI.6,05%0618 TSR	EUR	392 345,10	0,18	0,18
UNILEVER	EUR	391 150,00	0,18	0,18
GAZ C.5,136%220317	EUR	315 481,33	0,15	0,15
VALLOUREC 4,25%17	EUR	313 002,89	0,14	0,14
IMMOFIN.1,25%17 CV	EUR	247 031,41	0,11	0,11
SAINT-GOBAIN	EUR	224 505,62	0,10	0,10
NE PROP RTG3,75%21	EUR	217 989,44	0,10	0,10
LOXAM 7%230722 SUB	EUR	215 318,00	0,10	0,10
ANGLO AMER 2,5%21	EUR	209 196,96	0,10	0,10
RADIAN 6%09-19 TSR	EUR	158 141,79	0,07	0,07
PORTUGAL 5,875%18	EUR	152 490,00	0,07	0,07
HUGO BOSS NOM.	EUR	116 260,00	0,05	0,05
CGG 1,75%15 OCEANE	EUR	114 409,00	0,05	0,05
VERITAS 3,125%0121	EUR	112 288,31	0,05	0,05
DUERR 2,875%030421	EUR	109 680,10	0,05	0,05
GAZ CAPIT 4,625%18	EUR	106 751,70	0,05	0,05
PARPUBL.3,567%20	EUR	106 096,58	0,05	0,05
WIND ACQUISIT 7%21	EUR	105 695,11	0,05	0,05
MEDIASET 5%010217	EUR	105 019,83	0,05	0,05
TUI AG2,125%261021	EUR	103 034,71	0,05	0,05
AIR LIQUIDE	EUR	80 294,00	0,04	0,04
TOTAL	EUR	173 031 925,29	80,05	79,92
NOVO NORDISK B	DKK	342 596,58	0,16	0,16
TOTAL	DKK	342 596,58	0,16	0,16
CLARIANT NOM.	CHF	327 218,55	0,15	0,15
TOTAL	CHF	327 218,55	0,15	0,15
TOTAL		173 701 740,42	80,36	80,23

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

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Banques	11,92	11,89
Finance générale	7,34	7,32
Inv immobilier et serv	5,42	5,41
Souverains	5,39	5,38
Media	3,71	3,70
Industrie pharmaceutique et Biotechnologie	3,46	3,46
Autres secteurs économiques	43,12	43,07
TOTAL	80,36	80,23

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

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
FRANCE	14,98	14,98
ITALIE	11,69	11,67
ESPAGNE	9,73	9,72
AUTRES PAYS	43,96	43,86
TOTAL	80,36	80,23

VENTILATION DES AUTRES ACTIFS PAR NATURE

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
PARTS D'OPC	9,34	9,32
▪ OPC et Fonds d'investissement à vocation générale (non-professionnels)	9,34	9,32
▪ FCPR, FCPI, FIP ouverts à des investisseurs non professionnels	0,00	0,00
▪ Organisme de titrisation	0,00	0,00
▪ OPCI, SCPI ouverts à des investisseurs non professionnels	0,00	0,00
▪ SEF, SICAF et fonds de fonds alternatifs	0,00	0,00
▪ Fonds professionnels à vocation générale (ouverts à des investisseurs professionnels)	0,00	0,00
▪ OPCI professionnels, Fonds professionnels spécialisés et fonds professionnels de capital investissements	0,00	0,00
▪ Autres placements collectifs	0,00	0,00
AUTRES NATURES D'ACTIFS	0,00	0,00
▪ Bons de souscription	0,00	0,00
▪ Bons de caisse	0,00	0,00
▪ Billets à ordre	0,00	0,00
▪ Billets hypothécaires	0,00	0,00
▪ Autres	0,00	0,00
TOTAL	9,34	9,32

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	91 285 216,83
Cessions	54 684 945,71

PORTEFEUILLE TITRES DETAILLE

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
TOTAL Actions & valeurs assimilées						4 759 135,55	2,20
TOTAL Actions & valeurs assimilées négo. sur un marché régl. ou assimilé						4 759 135,55	2,20
TOTAL Actions & valeurs ass. nég. sur un marché régl. ou ass.(sauf Warrants et Bons de Sous.)						4 759 135,55	2,20
TOTAL SUISSE						327 218,55	0,15
CH0012142631 CLARIANT NOM.			CHF	20 000		327 218,55	0,15
TOTAL ALLEMAGNE						116 260,00	0,05
DE000A1PHFF7 HUGO BOSS NOM.			EUR	2 000		116 260,00	0,05
TOTAL DANEMARK						342 596,58	0,16
DK0060534915 NOVO NORDISK CL.B DIV.			DKK	10 000		342 596,58	0,16
TOTAL FRANCE						2 550 649,62	1,18
FR0000077919 JC DECAUX			EUR	25 000		698 250,00	0,32
FR0000120073 AIR LIQUIDE			EUR	760		80 294,00	0,04
FR0000125007 SAINT-GOBAIN			EUR	5 073		224 505,62	0,10
FR0004035913 ILIAD			EUR	6 000		1 095 900,00	0,51
FR0010533075 GROUPE EUROTUNNEL REGROUPT			EUR	50 000		451 700,00	0,21
TOTAL PAYS-BAS						1 422 410,80	0,66
NL0000009355 UNILEVER			EUR	10 000		391 150,00	0,18
NL0000009827 KONINKLIJKE DSM NOM.			EUR	18 105		1 031 260,80	0,48
TOTAL Obligations & Valeurs assimilées						157 812 554,37	73,01
TOTAL Obligations & valeurs assimilées négo. sur un marché régl. ou assimilé						157 812 554,37	73,01
TOTAL Obligations à taux fixe négo. sur un marché régl. ou assimilé						124 206 161,93	57,46
TOTAL AUSTRALIE						2 870 620,35	1,33
XS0543111768 MACQUARIE 6%10-210920 EMTN	21/09/2010	21/09/2020	EUR	30	6,00	1 797 248,84	0,83
XS0920705737 ORIGIN ENERGY 2,5%13-231020	23/04/2013	23/10/2020	EUR	1 000	2,50	1 073 371,51	0,50
TOTAL AUTRICHE						2 531 444,93	1,17
XS0840062979 ERSTE GROUP BK 7,125%12-1022	08/10/2012	10/10/2022	EUR	2 000	7,125	2 531 444,93	1,17
TOTAL BELGIQUE						8 187 861,61	3,79

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
BE0002428036 UCB 3,75%13-270320 EMTN	27/03/2013	27/03/2020	EUR	500	3,75	559 371,30	0,26
BE0002442177 UCB 4,125%13-040121	04/10/2013	04/01/2021	EUR	700	4,125	817 661,11	0,38
BE0002488634 UCB 1,875%15-020422	02/04/2015	02/04/2022	EUR	30	1,875	3 148 764,25	1,46
BE6272861657 ONTEX GROUP 4,75%14-151121	14/11/2014	15/11/2021	EUR	3 435	4,75	3 662 064,95	1,69
TOTAL BULGARIE						517 828,49	0,24
XS0989152573 BUL ENERGY HLDG 4,25%13-1118	07/11/2013	07/11/2018	EUR	500	4,25	517 828,49	0,24
TOTAL BRESIL						3 366 326,44	1,56
XS1017435782 BNDES 3,625%14-210119	21/01/2014	21/01/2019	EUR	1 000	3,625	1 068 617,21	0,49
XS1242327168 BRF 2,75%15-030622	03/06/2015	03/06/2022	EUR	2 200	2,75	2 297 709,23	1,07
TOTAL CAYMANES ILES						1 565 915,75	0,72
XS0955552178 BCO BRASIL CAYMAN 3,75%13-18	25/07/2013	25/07/2018	EUR	1 500	3,75	1 565 915,75	0,72
TOTAL CHYPRE						3 123 563,25	1,45
XS1151498737 AROUNDTOWN PROP 3%14-091221	09/12/2014	09/12/2021	EUR	15	3,00	1 543 965,66	0,71
XS1403685636 AROUNDTOWN PROP.TV16-030522	03/05/2016	03/05/2022	EUR	16	1,50	1 579 597,59	0,74
TOTAL REPUBLIQUE TCHEQUE						3 489 295,11	1,61
XS0783933350 EP ENERGY 5,875%12-011119	31/10/2012	01/11/2019	EUR	1 200	5,875	1 373 625,67	0,64
XS0808636244 EP ENERGY 4,375%13-010518	18/04/2013	01/05/2018	EUR	2 000	4,375	2 115 669,44	0,97
TOTAL ALLEMAGNE						9 486 287,04	4,39
DE000A1R0TU2 BILFINGER 2,375%12-071219	07/12/2012	07/12/2019	EUR	2 000	2,375	2 073 693,70	0,96
XS0468940068 LDBK BERL.5,875%09-251119 SUB	17/11/2009	25/11/2019	EUR	46	5,875	2 611 644,01	1,21
XS0997941355 KS 4,125%13-061221	06/12/2013	06/12/2021	EUR	1 000	4,125	1 133 114,38	0,52
XS1048589458 DUERR 2,875%14-030421	03/04/2014	03/04/2021	EUR	100	2,875	109 680,10	0,05
XS1211417362 ADLER 4,75%15-080420 RATING	08/04/2015	08/04/2020	EUR	1 978	4,75	2 101 932,14	0,97
XS1251078009 KIRK BEAU ZERO 6,25%15-150722	10/07/2015	15/07/2022	EUR	1 200	6,25	1 353 188,00	0,63
XS1504103984 TUI AG2,125%261021	26/10/2016	26/10/2021	EUR	1	2,125	103 034,71	0,05
TOTAL DANEMARK						1 161 721,10	0,54
XS0752467497 TDC 3,75%12-020322	02/03/2012	02/03/2022	EUR	1 000	3,75	1 161 721,10	0,54
TOTAL ESPAGNE						5 941 413,37	2,75
XS1117299211 CAMPOFRIO FOOD 3,375%15-0322	13/03/2015	15/03/2022	EUR	1 600	3,375	1 681 864,00	0,78
XS1265778933 CELLNEX TELECOM 3,125%15-0722	27/07/2015	27/07/2022	EUR	24	3,125	2 571 452,71	1,19

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
XS1416688890 METROVACESA INDX RTG 16-230522	23/05/2016	23/05/2022	EUR	16	2,375	1 688 096,66	0,78
TOTAL FINLANDE						1 303 302,49	0,60
FI4000210646 OUTOKUMPU 7,25% 16-160621	16/06/2016	16/06/2021	EUR	1 175	7,25	1 303 302,49	0,60
TOTAL FRANCE						23 952 987,90	11,08
FR0011052661 CASINO GUI.4,726% 11-260521EMTN	26/05/2011	26/05/2021	EUR	20	5,976	2 406 994,36	1,11
FR0011149947 VALLOUREC 4,25% 11-140217	14/12/2011	14/02/2017	EUR	3	4,25	313 002,89	0,14
FR0011302793 VALLOUREC 3,25% 12-020819	03/08/2012	02/08/2019	EUR	20	3,25	2 059 324,66	0,95
FR0011703776 BUREAU VERITAS 3,125% 14-210121	21/01/2014	21/01/2021	EUR	1	3,125	112 288,31	0,05
FR0011921881 VILMORIN 2,375% 14-260521	26/05/2014	26/05/2021	EUR	16	2,375	1 699 448,33	0,79
FR0011993120 NEOPOST 2,50% 14-230621	23/06/2014	23/06/2021	EUR	18	2,50	1 775 749,81	0,82
FR0012161362 LAGARDERE SCA 2% 14-190919	19/09/2014	19/09/2019	EUR	26	2,00	2 692 087,37	1,25
FR0012872174 BOLLORE 2,875% 15-290721	29/07/2015	29/07/2021	EUR	30	2,875	3 212 175,62	1,49
FR0013060076 DIRECT EN.4,40% 15-241120 TR.1	24/11/2015	24/11/2020	EUR	50	4,40	520 765,96	0,24
FR0013066669 HAVAS 1,875% 15-081220	08/12/2015	08/12/2020	EUR	5	1,875	521 992,81	0,24
XS1089828450 LOXAM 4,875% 14-230721 REG-S	23/07/2014	23/07/2021	EUR	1 400	4,875	1 465 208,50	0,68
XS1204116088 FAURECIA 3,125% 15-150622	17/03/2015	15/06/2022	EUR	2 798	3,125	2 895 657,20	1,34
XS1225112272 ELIS 3% 15-300422	28/04/2015	30/04/2022	EUR	2 475	3,00	2 571 698,25	1,19
XS1238996018 REXEL 3,25% 15-150622	27/05/2015	15/06/2022	EUR	1 150	3,25	1 204 055,75	0,56
XS1538867760 SOCIETE GENERALE 1% 16-010422	21/12/2016	01/04/2022	EUR	5	1,00	502 538,08	0,23
TOTAL ROYAUME UNI						4 881 432,30	2,26
XS0923361827 ANGLO AMER CAPITAL 2,5% 13-0421	29/04/2013	29/04/2021	EUR	200	2,50	209 196,96	0,10
XS1204272709 MERLIN ENTMTS 2,75% 15-150322	19/03/2015	15/03/2022	EUR	3 000	2,75	3 153 630,00	1,46
XS1211292484 ANGLO AMER CAPITAL 1,5% 15-0420	01/04/2015	01/04/2020	EUR	1 500	1,50	1 518 605,34	0,70
TOTAL ITALIE						18 634 917,15	8,62
XS0452166324 INTESA SAN 5% 09-0919 SUB EMTN	10/09/2009	23/09/2019	EUR	26	5,00	1 422 593,38	0,66
XS0483005293 MEDIASET 5% 10-010217 REG-S	01/02/2010	01/02/2017	EUR	100	5,00	105 019,83	0,05
XS0526326334 INTESA 5,15% 10-160720 EMTN	16/07/2010	16/07/2020	EUR	45	5,15	2 534 169,14	1,17
XS0923605470 INDESIT COMPANY 4,5% 13-260418	26/04/2013	26/04/2018	EUR	400	4,50	434 299,40	0,20
XS0953207759 AMPLIFON 4,875% 13-160718	16/07/2013	16/07/2018	EUR	1 155	4,875	1 257 193,29	0,58
XS0985395655 MEDIASET 5,125% 13-240119	24/10/2013	24/01/2019	EUR	2 582	5,125	2 915 128,16	1,35

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
XS1050546883 BENI STABIL.3,5%14-010419	31/03/2014	01/04/2019	EUR	1 250	3,50	1 354 152,05	0,63
XS1205716720 AUTOSTR BRESCIA 2,375%15-0320	20/03/2015	20/03/2020	EUR	1 500	2,375	1 592 002,19	0,74
XS1214547777 PRYSMIAN 2,5%15-110422	09/04/2015	11/04/2022	EUR	3 209	2,50	3 330 260,64	1,53
XS1300465926 CAMPARI 2,75%15-300920	30/09/2015	30/09/2020	EUR	1 100	2,75	1 180 902,29	0,55
XS1435297202 SALINI IMPR 3,75%16-240621	24/06/2016	24/06/2021	EUR	2 322	3,75	2 509 196,78	1,16
TOTAL JERSEY						1 760 635,03	0,81
XS0918754895 ATRIUM EURO RE 4%13-200420	19/04/2013	20/04/2020	EUR	1 568	4,00	1 760 635,03	0,81
TOTAL LUXEMBOURG						14 039 134,42	6,49
XS0276455937 GAZ CAPIT.5,136%06-220317 MTN	22/11/2006	22/03/2017	EUR	300	5,136	315 481,33	0,15
XS0805582011 GAZ CAPITAL 3,755%12-150317	19/07/2012	15/03/2017	EUR	2 280	3,755	2 364 965,92	1,09
XS1055940206 WIND ACQUISITION 7%14-230421	23/04/2014	23/04/2021	EUR	100	7,00	105 695,11	0,05
XS1082636876 WIND ACQUISITION 4%14-150720	10/07/2014	15/07/2020	EUR	2 700	4,00	2 807 532,00	1,30
XS1117298833 PICARD BONDCO 7,75%15-010220	20/02/2015	01/02/2020	EUR	2 250	7,75	2 430 680,00	1,12
XS1174211471 EUROFIN SCIENTIFIC 2,25%15-22	27/01/2015	27/01/2022	EUR	2 544	2,25	2 616 388,48	1,21
XS1214673722 ARCELORMITTAL 3%15-090421	09/04/2015	09/04/2021	EUR	1 500	3,00	1 612 334,38	0,75
XS1307381928 GAZ CAPITAL 4,625%15-151018	15/10/2015	15/10/2018	EUR	100	4,625	106 751,70	0,05
XS1432585997 BMBG BOND FINAN 3%16-150621	15/06/2016	15/06/2021	EUR	1 000	3,00	1 046 130,00	0,48
XS1433185755 CONTOURGLOBAL 5,125%16-150621	17/06/2016	15/06/2021	EUR	600	5,125	633 175,50	0,29
TOTAL PAYS-BAS						8 265 126,87	3,82
XS0496281618 COOP.RABOBK 6,875%10-190320	19/03/2010	19/03/2020	EUR	46	6,875	2 841 266,56	1,31
XS0802995166 ABN AMRO 7,125%12-060722	06/07/2012	06/07/2022	EUR	2 600	7,125	3 416 509,70	1,58
XS0843939918 PORTUGAL TELE INTL 5,875%12-18	17/10/2012	17/04/2018	EUR	500	5,875	152 490,00	0,07
XS1028954953 BHARTI AIRTEL 3,375%14-200521	20/05/2014	20/05/2021	EUR	700	3,375	774 313,53	0,36
XS1246049073 GRUPO ANTOL DU 5,125%15-0622	23/06/2015	30/06/2022	EUR	1 000	5,125	1 080 547,08	0,50
TOTAL NORVEGE						1 309 301,54	0,61
XS0754846235 DNB BK ASA 4,75%12-080322	08/03/2012	08/03/2022	EUR	1 250		1 309 301,54	0,61
TOTAL PORTUGAL						2 956 741,52	1,37
PTGALIOE0009 GALP ENER.4,125%13-250119 EMTN	25/11/2013	25/01/2019	EUR	15	4,125	1 661 205,74	0,77
PTGALJOE0008 GALP ENERGIA 3%14-140121 EMTN	14/07/2014	14/01/2021	EUR	11	3,00	1 189 439,20	0,55
XS0230315748 PARPUBLICA 3,567%05-20	22/09/2005	22/09/2020	EUR	100	3,567	106 096,58	0,05

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
TOTAL SUEDE						1 084 913,67	0,50
XS0285176458 STENA 6,125%07-010217	08/02/2007	01/02/2017	EUR	1 050	6,125	1 084 913,67	0,50
TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE						3 775 391,60	1,75
XS0982708686 DISCOVERY COMM 2,375%14-0322	07/03/2014	07/03/2022	EUR	1 000	2,375	1 078 940,68	0,50
XS1069522057 JEFFERIES GROUP 2,375%14-0520	20/05/2014	20/05/2020	EUR	2 554	2,375	2 696 450,92	1,25
TOTAL Obligations à taux variable, révisable négo. sur un marché régl. ou assimilé						2 225 115,10	1,03
TOTAL ITALIE						1 183 881,93	0,55
IT0004776230 UNICREDIT TV11-191217	19/12/2011	19/12/2017	EUR	1 170		1 183 881,93	0,55
TOTAL PORTUGAL						1 041 233,17	0,48
PTGALDOM0004 GALP ENERGIA TV12-180218	18/12/2012	18/02/2018	EUR	10		1 041 233,17	0,48
TOTAL Obligations convertibles négo. sur un marché régl. ou assimilé						18 630 613,22	8,62
TOTAL AUTRICHE						247 031,41	0,11
XS0332046043 IMMOFINANZ 1,25%07-191117 CV	19/11/2007	19/11/2017	EUR	2	1,25	247 031,41	0,11
TOTAL BELGIQUE						1 329 323,33	0,61
BE0933899800 BNPP FORTIS TV07-PERP SUB.CONV	19/12/2007	31/12/2050	EUR	8		1 329 323,33	0,61
TOTAL ALLEMAGNE						1 339 827,55	0,62
DE000A161XW6 ADLER 2,5%16-190721 CONV.REGS	19/07/2016	19/07/2021	EUR	31 258	2,50	476 309,40	0,22
DE000A168YY5 SGL CARBON 3,5%15-300920 CONV	14/09/2015	30/09/2020	EUR	9	3,50	863 518,15	0,40
TOTAL ESPAGNE						3 968 948,87	1,84
XS0981383747 INDRA 1,75%13-171018 CONV.	17/10/2013	17/10/2018	EUR	4	1,75	400 940,00	0,19
XS1063399700 SACYR 4%14-080519 CV SENIOR	08/05/2014	08/05/2019	EUR	13	4,00	1 144 061,04	0,53
XS1322536332 INTL.C.AIR 0,25%15-171120	17/11/2015	17/11/2020	EUR	18	0,25	1 662 074,25	0,77
XS1500463358 INDRA SISTEMAS 1,25%16-1023 CV	07/10/2016	07/10/2023	EUR	8	1,25	761 873,58	0,35
TOTAL FRANCE						1 165 649,00	0,54
FR0012739548 CGG 1,75%15-010120 OCEANES	30/06/2015	01/01/2020	EUR	47 750	1,75	114 409,00	0,05
FR0012799229 NEOPOST TV15-PERP ODIRNANE CV	16/06/2015	31/12/2050	EUR	20 500		1 051 240,00	0,49
TOTAL ITALIE						4 223 466,56	1,97
XS1069899232 SAFILO GROUP 1,25%14-220519 CV	22/05/2014	22/05/2019	EUR	24	1,25	2 281 920,66	1,07
XS1209185161 TELECOM 1,125%15-260322 CONV	26/03/2015	26/03/2022	EUR	10	1,125	978 426,66	0,45

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
XS1268574891 BENI STABILI 7/8%15-0121 CONV.	03/08/2015	31/01/2021	EUR	10	0,875	963 119,24	0,45
TOTAL LUXEMBOURG						3 187 420,60	1,47
XS0147484074 FORTFINLUX TV02-PERP.REGS CV	07/05/2002	31/12/2050	EUR	9		1 096 774,10	0,51
XS0878451920 GVM DEB.LUX 5,75%13-0218 EXCH	14/02/2013	14/02/2018	EUR	6	5,75	558 436,50	0,26
XS1082775054 FF GROUP 1,75%14-030719 CONV	03/07/2014	03/07/2019	EUR	17	1,75	1 532 210,00	0,70
TOTAL MEXIQUE						1 458 075,00	0,67
XS1238034695 AMERICA MOVIL 0%15-280520 EXCH	28/05/2015	28/05/2020	EUR	15		1 458 075,00	0,67
TOTAL PAYS-BAS						1 710 870,90	0,79
XS0937410214 AMORIM 3,375%030618 CV GALP EN	03/06/2013	03/06/2018	EUR	16	3,375	1 710 870,90	0,79
TOTAL Obligations indexées négo. sur un marché régl. ou assimilé						2 802 336,32	1,30
TOTAL ROYAUME UNI						2 584 346,88	1,20
XS0860855930 INTL GAME TECH. INDX RTG12-20	05/12/2012	05/03/2020	EUR	16	4,75	1 832 594,63	0,85
XS1041793123 ICAP GROUP INDX RTG 14-060319	06/03/2014	06/03/2019	EUR	700	3,125	751 752,25	0,35
TOTAL PAYS-BAS						217 989,44	0,10
XS1325078308 NE PROP COOP RTG3,75%15-260221	30/11/2015	26/02/2021	EUR	200	3,75	217 989,44	0,10
TOTAL Titres subordonnés (TSR - TSDI)						9 948 327,80	4,60
TOTAL FRANCE						4 706 567,96	2,18
FR0010259473 CREDIT AGR.4,05%05-20 TSR	30/11/2005	22/12/2020	EUR	2 000 000	4,05	2 020 780,00	0,94
FR0010622035 RADIAN 6,05%08-260618 TSR	20/06/2008	26/06/2018	EUR	352 499	6,05	392 345,10	0,18
FR0010762781 RADIAN 6%09-19 TSR	26/06/2009	26/06/2019	EUR	136 000	6,00	158 141,79	0,07
FR0010905158 RADIAN 4,55%10-280620 TSR	08/06/2010	28/06/2020	EUR	771 210	4,55	888 688,63	0,41
FR0010941021 CRED.AGRICOLE 4%10-300922 TSR	30/09/2010	30/09/2022	EUR	1 000 000	4,00	1 031 294,44	0,48
XS1089828880 LOXAM 7%14-230722 REG-S SUB	23/07/2014	23/07/2022	EUR	200	7,00	215 318,00	0,10
TOTAL ROYAUME UNI						3 022 567,31	1,40
XS0527239221 NATIONWIDE 6,75%10-220720 SUB.	22/07/2010	22/07/2020	EUR	1 144	6,75	1 412 329,43	0,65
XS0858585051 STD CHARTERED 3,625%12-231122	23/11/2012	23/11/2022	EUR	1 500	3,625	1 610 237,88	0,75
TOTAL ITALIE						1 218 901,53	0,56
IT0004645542 MEDIOBANCA-BCA 5%10-151120	15/11/2010	15/11/2020	EUR	1 100	5,00	1 218 901,53	0,56
TOTAL PAYS-BAS						1 000 291,00	0,46
XS0113243470 ABN AMRO TV00-300617 S.261	30/06/2000	30/06/2017	EUR	10		1 000 291,00	0,46

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
TOTAL Titres de créances						11 130 050,50	5,15
TOTAL Titres de créances négociés sur un marché régl. ou assimilé						11 130 050,50	5,15
TOTAL Titres de créances négociables						11 130 050,50	5,15
TOTAL ESPAGNE						11 130 050,50	5,15
ES0L01702171 ESPAGNE 0%16-170217 LETRAS	19/02/2016	17/02/2017	EUR	500		500 250,50	0,23
ES0L01704078 ESPAGNE 0%16-070417 LETRAS	08/04/2016	07/04/2017	EUR	600		600 750,00	0,28
ES0L01708186 SPAIN 0%16-070417 LETRAS	19/08/2016	18/08/2017	EUR	5 000		5 011 800,00	2,32
ES0L01712089 SPAIN 0%16-081217	09/12/2016	08/12/2017	EUR	5 000		5 017 250,00	2,32
TOTAL Titres d'OPC						20 178 621,22	9,34
TOTAL OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'UE						20 178 621,22	9,34
TOTAL FRANCE						20 178 621,22	9,34
FR0000009987 UNION + SI.3DEC			EUR	10		1 913 964,30	0,89
FR0000979825 UNION CASH FCP 3DEC			EUR	4		2 050 391,72	0,95
FR0007018239 TRUSTEAM ROC FLEX FCP 3DEC			EUR	4 500		1 023 435,00	0,47
FR0007476734 MEYERBEER TRESORERIE C FCP3DEC			EUR	4 220		8 674 505,40	4,01
FR0010602540 VALEURS CROISS.RDM IC FCP 4DEC			EUR	4 000		946 120,00	0,44
FR0010985804 TRUSTEAM ROC PART B FCP 3DEC			EUR	5 500		2 265 065,00	1,05
FR0011273333 LAFFITTE DIVESIF.RET.I FCP 4D			EUR	1 180		1 302 259,80	0,60
FR0013223328 CREDITMAX EUR.SPR.F FCP 4DEC			EUR	2 000		2 002 880,00	0,93
TOTAL Contrats financiers						-184 221,85	-0,09
TOTAL Contrats financiers avec appel de marge						0,00	0,00
TOTAL Engagements à terme fermes						0,00	0,00
FGBMH7F00002 BOBL-EUX 0317			EUR	-10		-12 800,00	-0,01
TOTAL FRANCE						12 800,00	0,00
MARF.EUR Appels marge futures			EUR	12 800		12 800,00	0,00
TOTAL Engagements à terme conditionnels						-184 221,85	-0,09
TOTAL Engagements à terme conditionnels sur marché réglementé						-184 221,85	-0,09
CLNXH7C00001 CLN/0317/CALL/18.			CHF	-200		-9 311,85	0,00
DCSXM7C00001 DCS/0617/CALL/30.			EUR	-250		-25 000,00	-0,01
DSM-F7C00001 DSM/0117/CALL/60.			EUR	-80		-1 680,00	0,00

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
DSM-H7C00001 DSM/0317/CALL/60.			EUR	-100		-10 500,00	-0,02
IL1XH7C00001 IL1/0317/CALL/185.			EUR	-60		-52 980,00	-0,02
OESXF7C00004 OESX/0117/CALL/3,300			EUR	-100		-41 900,00	-0,02
SG1XH7C00008 SG1/0317/CALL/40.			EUR	-50		-24 550,00	-0,01
UNIXH7C00001 UNI/0317/CALL/38.			EUR	-100		-18 300,00	-0,01

RÈGLEMENT SFTR

Cet OPC n'est pas intervenu sur des opérations soumises au Règlement UE 2015/2365 relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation (« Règlement SFTR ») au cours de la période et n'a donc pas d'information à communiquer aux investisseurs à ce titre.