



30/09/2021

Fonds de droit français

**GROUPAMA SELECTION
PROTECT 85**

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	
b) Avoirs bancaires	38 681,33
c) Autres actifs détenus par l'OPC	8 161 873,27
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	8 200 554,60
e) Passif	-87 366,64
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	8 113 187,96

* Les montants sont signés

NOMBRE D'ACTION EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

Action	Type d'action	Actif net par action	Nombre d'actions en circulation	Valeur nette d'inventaire par action
GROUPAMA GROUPAMA SELECTION PROTECT ACTION EI en EUR	C	230 656,43	2 299,8383	100,29
GROUPAMA GROUPAMA SELECTION PROTECT ACTION N en EUR	C	7 882 531,53	78 564,891	100,33

ELEMENT 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>		
<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>		
<p>D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.</p>		
<p>E) Les autres actifs.</p>	96,60	95,57

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

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

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
NEANT				

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

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

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RESIDENCE DE L'EMETTEUR

Pays	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
NEANT		

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

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

REPARTITION 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	96,60	95,57
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 actifs		
Autres		
TOTAL	96,60	95,57

* 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.		
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.		
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	37 617 436,97	134 414 455,64

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 30/09/2021 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
ALLEMAGNE				
iShares Edge MSCI World Minimum Volatility UCITS ETF USD (Ac	USD	23 200	1 156 446,78	14,25
TOTAL ALLEMAGNE			1 156 446,78	14,25
FRANCE				
BNP PARIBAS MOIS ISR FCP	EUR	3,511	79 994,51	0,98
BNPP INV 3 MOIS I PLUS C	EUR	0,082	81 453,24	1,00
BNPP MONEY 3M IC	EUR	3,752	86 181,15	1,06
G FUND EQUITY CONVICTIONS ISR O	EUR	4,5	104 131,53	1,29
G FUND - WORLD VISION R O	EUR	5,582	85 718,48	1,06
GROUPAMA CREDIT EURO O	EUR	3	44 873,55	0,55
GROUPAMA ENTREPRISES IC	EUR	551,3402	1 243 613,98	15,33
GROUPAMA EUROPE EQUITIES O	EUR	11,4	174 284,34	2,15
GROUPAMA MONETAIRE IC	EUR	4,855	1 032 094,64	12,73
GROUPAMA TRESORERIE IC	EUR	34,8836	1 393 211,91	17,18
GROUPAMA ULTRA SHORT TERM BOND IC	EUR	5	50 068,05	0,61
GROUPAMA US EQUITIES O	USD	27,499	431 621,95	5,32
TOTAL FRANCE			4 807 247,33	59,26
LUXEMBOURG				
AMUNDI MSCI WORLD UCITS ETF - EUR C	EUR	533	211 279,17	2,60
G FUND-AVENIR EUROPE-IC	EUR	183,469	618 870,29	7,63
SPDR MSCI US SM-CP VAL WGHT	USD	3 700	175 685,75	2,17
VONTOBEL EM MC BD -X- CAP	USD	5 365	867 741,71	10,69
TOTAL LUXEMBOURG			1 873 576,92	23,09
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			7 837 271,03	96,60
TOTAL Organismes de placement collectif			7 837 271,03	96,60
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
EURO STOXX 50 I22I	EUR	3	-3 127,50	-0,04
SP 500 MINI I22I	USD	3	-19 569,44	-0,24
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			-22 696,94	-0,28
TOTAL Engagements à terme fermes			-22 696,94	-0,28
Autres instruments financiers à terme				
Swaps d'inflation				

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2021 EN EUR(suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TRS DUMMY P85 0.33	EUR	1	-964,85	-0,01
TOTAL Swaps d'inflation			-964,85	-0,01
TOTAL Autres instruments financiers à terme			-964,85	-0,01
TOTAL Instrument financier à terme			-23 661,79	-0,29
Appel de marge				
APPEL MARGE CACEIS	USD	22 679,61	19 569,10	0,24
APPEL MARGE CACEIS	EUR	3 127,5	3 127,50	0,04
TOTAL Appel de marge			22 696,60	0,28
Créances			301 905,64	3,72
Dettes			-63 704,85	-0,79
Comptes financiers			38 681,33	0,48
Actif net			8 113 187,96	100,00