



H2O
Asset Management

OPCVM de droit français

H2O MULTISTRATEGIES FCP

PUBLICATION SEMESTRIELLE

au 29 septembre 2023

Société de gestion : H2O AM EUROPE

Dépositaire : Caceis Bank

Commissaire aux comptes : KPMG Audit

H2O AM EUROPE 39 avenue Pierre 1er de Serbie - 75008 Paris France - Tél. : +33 (0)1 87 86 65 11
Société de gestion de portefeuille agréée par l'Autorité des Marchés Financiers sous le numéro GP-19000011
Société par actions simplifiée immatriculée au RCS de Paris sous le N° 843 082 538

www.h2o-am.com

Commercialisateur :

H2O AM EUROPE 39 avenue Pierre 1er de Serbie - 75008 Paris France
Tél. : +33 (0)1 87 86 65 11

www.h2o-am.com

● 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	223 073 599,61
b) Avoirs bancaires	14 734 070,69
c) Autres actifs détenus par l'OPC	2 122 980 350,74
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	2 360 788 021,04
e) Passif	-2 071 367 657,93
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	289 420 363,11

* 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
H2O MULTISTRATEGIES FCP HCHF-I(C) en CHF	C	620 003,67	4,9463	125 346,96
H2O MULTISTRATEGIES FCP HCHF-R(C) en CHF	C	890 532,22	4 876,6812	182,61
H2O MULTISTRATEGIES FCP HSGD-R(C) en SGD	C	677 123,54	4 693,2027	144,27
H2O MULTISTRATEGIES FCP IEUR(C) en EUR	C	17 792 993,56	64,4916	275 896,29
H2O MULTISTRATEGIES FCP IUSD(C) en USD	C	17 520,66	0,1400	125 147,57
H2O MULTISTRATEGIES FCP NEUR(C) en EUR	C	8 798 805,20	108 125,7407	81,37
H2O MULTISTRATEGIES FCP REUR(C) en EUR	C	259 232 640,83	1 010 463,8462	256,54
H2O MULTISTRATEGIES FCP RUSD(C) en USD	C	1 642 359,53	12 520,5159	131,17

● ELÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
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. 422-1 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.	10,42	1,28
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.	66,66	8,17
D) Les titres financiers éligibles 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.	1,72	0,21

* 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 **
Peso Mexicain	MXN	159 602 974,17	55,15	6,76
Euro	EUR	30 381 272,80	10,50	1,29
Dollar Us	USD	16 211 519,90	5,60	0,69
Rand	ZAR	12 896 998,88	4,46	0,55
Rouble Russe	RUB	3 980 833,86	1,38	0,17
TOTAL		223 073 599,61	77,08	9,45

* 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 **
MEXIQUE	56,94	6,98
FRANCE	7,71	0,95
AFRIQUE DU SUD	4,46	0,55
RUSSIE	2,64	0,32
BELGIQUE	1,71	0,21
UKRAINE	1,67	0,20
BRESIL	0,49	0,06
COLOMBIE	0,46	0,06
ITALIE	0,31	0,04
ALLEMAGNE	0,27	0,03
ESPAGNE	0,21	0,03
PORTUGAL	0,18	0,02
GRECE	0,02	0,00
TOTAL	77,08	9,45

* 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	1,72	0,21
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE	0,00	0,00
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés	0,00	0,00
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés	0,00	0,00
Autres organismes non européens	0,00	0,00
Autres actifs		
Autres	0,00	0,00
TOTAL	1,72	0,21

* 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 PÉRIODE EN EUR

Éléments 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. 422-1 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.	151 061 980,10	172 524 448,29
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.	32 604 570,11	15 255 842,70
D) Les titres financiers éligibles 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.	0,00	211 556,15

• INFORMATIONS DIVERSES

Etablissement dépositaire : Caceis Bank - 12 place des États-Unis - CS 40083 - 92549 - Montrouge Cedex

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 :

H2O AM EUROPE - 39 avenue Pierre 1er de Serbie - 75008 Paris - France

● INFORMATION SUR LES FRAIS DE GESTION VARIABLES

	29/09/2023
Parts H2O MULTISTRATEGIES FCP HCHF-I(C)	
Frais de gestion variables provisionnés	3 744,53
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,60
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Parts H2O MULTISTRATEGIES FCP HCHF-R(C)	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Parts H2O MULTISTRATEGIES FCP HSGD-R(C)	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Parts H2O MULTISTRATEGIES FCP IEUR(C)	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	128,18
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Parts H2O MULTISTRATEGIES FCP IUSD(C)	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Parts H2O MULTISTRATEGIES FCP NEUR(C)	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Parts H2O MULTISTRATEGIES FCP REUR(C)	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00

« Le montant des frais de gestion variables affiché ci-dessus correspond à la somme des provisions et reprises de provisions ayant impacté l'actif net au cours de la période sous revue. »

● **INFORMATION SUR LES FRAIS DE GESTION VARIABLES (suite)**

	29/09/2023
Parts H2O MULTISTRATEGIES FCP RUSD(C)	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00

« Le montant des frais de gestion variables affiché ci-dessus correspond à la somme des provisions et reprises de provisions ayant impacté l'actif net au cours de la période sous revue. »

- **TRANSPARENCE DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA RÉUTILISATION DES INSTRUMENTS FINANCIERS - RÈGLEMENT 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 DÉTAILLÉ AU 29/09/2023 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				
MEXIQUE				
URBI DESARROLLOS URBANOS	MXN	24 401	9 150,62	0,01
TOTAL MEXIQUE			9 150,62	0,01
TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			9 150,62	0,01
TOTAL Actions et valeurs assimilées			9 150,62	0,01
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
AFRIQUE DU SUD				
REPUBLIQUE SUDAFRICAIN 8.875% 28-02-35	ZAR	322 600 000	12 896 998,88	4,46
TOTAL AFRIQUE DU SUD			12 896 998,88	4,46
ALLEMAGNE				
DEUTSCHE BK USSW5+4.358% PERP	USD	1 000 000	788 526,21	0,27
TOTAL ALLEMAGNE			788 526,21	0,27
BRESIL				
BRAZ GO 4.75 01-50	USD	2 100 000	1 406 585,67	0,49
TOTAL BRESIL			1 406 585,67	0,49
COLOMBIE				
COLOMBIA GOVERNMENT INTL BOND 4.125% 22-02-42	USD	2 300 000	1 338 285,91	0,46
TOTAL COLOMBIE			1 338 285,91	0,46
ESPAGNE				
BANCO NTANDER 4.125% PERP	EUR	800 000	608 031,04	0,21
TOTAL ESPAGNE			608 031,04	0,21
FRANCE				
BQ POSTALE 3.0% PERP	EUR	1 000 000	644 646,96	0,22
TOTAL FRANCE			644 646,96	0,22
GRECE				
GRECE 15/10/2042	EUR	19 821 900	71 160,62	0,02
TOTAL GRECE			71 160,62	0,02
ITALIE				
INTESA SANPAOLO 7.75% PERP	EUR	900 000	891 936,20	0,31
TOTAL ITALIE			891 936,20	0,31
MEXIQUE				
CORPORACION GEO 8.875% 03/22 DEFAULT	USD	4 000 000	415,58	0,00
CORPORACION GEO SA DE CV 9.25% 30-06-20 DEFAULT	USD	4 280 000	80,85	0,00
MEXICAN BONOS 5.5% 04-03-27	MXN	4 000 000	18 855 753,93	6,52
MEXICAN BONOS 7.5% 03-06-27 - PAYE TOUS LES 182 JOURS	MXN	5 600 000	28 661 061,44	9,90
MEXICAN BONOS 7.5% 26-05-33	MXN	1 000 000	4 780 030,25	1,66
MEXICAN BONOS 7.75% 23-11-34	MXN	900 000	4 329 105,41	1,49
MEXICAN BONOS 7.75% 29-05-31	MXN	7 566 085	37 510 559,61	12,96
MEXICAN BONOS 8.5% 31-05-29	MXN	12 448 198	65 457 312,91	22,61
PETROLEOS MEXICANOS 8.75% 02-06-29	USD	6 000 000	5 206 439,98	1,80
TOTAL MEXIQUE			164 800 759,96	56,94
PORTUGAL				
BCO ESPI 4.75% 15-01-18 EMTN DEFAULT	EUR	1 600 000	263 504,00	0,09

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/09/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
NOVO BAN 0.0% 08-05-17 EMTN DEFAULT	EUR	1 500 000	266 295,00	0,09
TOTAL PORTUGAL			529 799,00	0,18
RUSSIE				
RFLB 7% 16/08/2023	RUB	40 440 000	0,00	0,00
RUSSIA 5 1/4 06/23/47	USD	4 200 000	778 386,78	0,27
RUSSIA GOVT BOND OFZ 8.15% 02/27	RUB	328 142 000	595 427,87	0,21
RUSSIAN FEDERAL BOND OFZ 4.5% 16-07-25	RUB	65 090 000	119 206,20	0,04
RUSSIAN FEDERAL BOND OFZ 6.0% 06-10-27	RUB	33 100 000	65 165,45	0,03
RUSSIAN FEDERAL BOND OFZ 6.1% 18-07-35	RUB	1 525 365 000	2 069 480,63	0,71
RUSSIAN FEDERAL BOND OFZ 6.5% 28-02-24	RUB	86 900 000	257 230,66	0,09
RUSSIAN FEDERAL BOND OFZ 6.9% 23-05-29	RUB	164 000 000	314 943,04	0,11
RUSSIAN FEDERAL BOND OFZ 7.1% 16-10-24	RUB	44 000 000	122 329,26	0,04
RUSSIAN FEDERAL BOND OFZ 7.15% 12-11-25	RUB	26 882 000	53 858,90	0,02
RUSSIAN FEDERAL BOND OFZ 7.4% 17-07-24	RUB	14 190 000	37 105,06	0,01
RUSSIAN FEDERAL BOND OFZ 7.95% 07-10-26	RUB	29 572 000	60 864,71	0,02
RUSSIAN FEDERATION 5.625% 04/04/2042	USD	1 800 000	1 206 469,66	0,42
RUSSIAN FOREIGN BOND EUROBOND 4.25% 23-06-27	USD	6 400 000	1 675 537,29	0,58
RUSSIE FED OF 7.75% 16-09-26	RUB	165 605 000	285 222,08	0,09
TOTAL RUSSIE			7 641 227,59	2,64
UKRAINE				
UKRAINE GOVERNMENT INTL BOND 6.75% 20-06-28	EUR	3 850 000	1 019 672,50	0,35
UKRAINE GOVERNMENT INTL BOND 7.75% 01-09-25	USD	600 000	188 622,43	0,07
UKRAINE GOVERNMENT INTL BOND 7.75% 01-09-26	USD	4 600 000	1 311 852,66	0,45
UKRAINE GOVERNMENT INTL BOND 7.75% 01-09-27	USD	4 600 000	1 260 758,44	0,44
UKRAINE GOVERNMENT INTL BOND 7.75% 01-09-28	USD	700 000	193 943,80	0,07
UKRAINE GOVERNMENT INTL BOND 7.75% 01-09-29	USD	3 100 000	855 614,64	0,29
TOTAL UKRAINE			4 830 464,47	1,67
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			196 448 422,51	67,87
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			196 448 422,51	67,87
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
BELGIQUE				
BELG TREA BILL ZCP 11-01-24	EUR	5 000 000	4 946 286,62	1,71
TOTAL BELGIQUE			4 946 286,62	1,71
FRANCE				
FRENCH REPUBLIC ZCP 13-12-23	EUR	7 750 000	7 691 634,05	2,66
FRENCH REPUBLIC ZCP 20-12-23	EUR	14 100 000	13 978 105,81	4,83
TOTAL FRANCE			21 669 739,86	7,49
TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			26 616 026,48	9,20
TOTAL Titres de créances			26 616 026,48	9,20
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
H2O MULTIASIA I/C (USD)	USD	24 000	2 023 367,18	0,69
TOTAL FRANCE			2 023 367,18	0,69

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/09/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
LUXEMBOURG				
H2O LUX INVEST -GLOBAL L/S OPPORTUNIT S ACC	EUR	5 800	129 032,60	0,05
SATELLITE EVENT-DRIVEN SEEDER	EUR	4 000	2 839 680,00	0,98
TOTAL LUXEMBOURG			2 968 712,60	1,03
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			4 992 079,78	1,72
TOTAL Organismes de placement collectif			4 992 079,78	1,72
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
CBOT USUL 30A 1223	USD	-544	3 484 179,46	1,20
DJE 600 EUROP 1223	EUR	347	-82 552,50	-0,03
DJE 600 INDUS 1223	EUR	-514	268 875,00	0,10
DJE 600 OIL G 1223	EUR	868	289 800,00	0,10
DJES BANKS 1223	EUR	17 359	2 889 551,75	1,00
DJS BAS R FUT 1223	EUR	647	731 102,50	0,25
DJS F&B FUT 1223	EUR	-884	1 123 055,00	0,39
DJS TECH FUT 1223	EUR	-875	1 096 585,00	0,38
DJ STOXX HC 1223	EUR	-79	104 257,50	0,03
DJ STX600 AUT 1223	EUR	1 198	23 365,00	0,01
E-MIN RUS 200 1223	USD	-737	2 104 524,20	0,72
EURO BOBL 1223	EUR	65	6 665,00	0,01
EURO BTP 1223	EUR	1 805	-7 345 815,00	-2,54
EURO BUND 1223	EUR	-1 408	2 324 730,00	0,80
EURO-OAT 1223	EUR	-160	434 820,00	0,15
EURO SCHATZ 1223	EUR	796	67 935,00	0,02
EURO STOXX 50 1223	EUR	-900	623 015,00	0,21
FTSE 100 FUT 1223	GBP	-92	-80 078,40	-0,03
FV CBOT UST 5 1223	USD	6 087	-4 172 007,82	-1,44
JAP GOVT 10 1223	JPY	-67	496 164,52	0,17
MME MSCI EMER 1223	USD	842	-1 038 389,61	-0,36
NIKKEI 225 1223	JPY	-171	397 135,01	0,14
NQ USA NASDAQ 1223	USD	21	-224 798,11	-0,07
OSE TOPIX FUT 1223	JPY	123	-124 003,15	-0,05
SOFRRATE 3M 1223	USD	306	-19 870,13	-0,01
SP 500 MINI 1223	USD	-249	179 551,36	0,07
TU CBOT UST 2 1223	USD	1 350	-544 458,37	-0,18
US 10YR NOTE 1223	USD	-1 424	2 277 855,67	0,78
US TBOND 30 1223	USD	-1 016	5 363 614,22	1,85
XEUR FGBX BUX 1223	EUR	-21	148 350,00	0,05
XEUR FSMI SWI 1223	CHF	-14	7 010,48	0,01
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			10 810 168,58	3,73
TOTAL Engagements à terme fermes			10 810 168,58	3,73
Engagements à terme conditionnels				
Engagements à terme conditionnels sur marché réglementé				
BBG CALC SOFR 3M 03/2024 CALL 97.5	USD	1 080	54 191,26	0,02
BBG CALC SOFR 3M 03/2024 CALL 98.25	USD	-2 160	-70 129,87	-0,03
BBG CALC SOFR 3M 03/2024 CALL 99	USD	1 080	19 126,33	0,01

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/09/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BBG CALC SOFR 3M 12/2023 CALL 96.75	USD	1 100	16 233,77	0,01
BBG CALC SOFR 3M 12/2023 CALL 97	USD	720	12 750,89	0,01
BBG CALC SOFR 3M 12/2023 CALL 97.5	USD	720	8 500,59	0,00
BBG CALC SOFR 3M 12/2023 CALL 98	USD	-1 440	-8 500,59	0,00
BBG CALC SOFR 3M 12/2023 CALL 98.25	USD	-720	-6 375,44	0,00
BBG CALC SOFR 3M 12/2023 CALL 98.5	USD	-2 200	-12 987,01	-0,01
BBG CALC SOFR 3M 12/2023 CALL 99	USD	720	4 250,30	0,00
BBG CALC SOFR 3M 12/2023 CALL 99.5	USD	1 100	6 493,51	0,00
CBOT US TRES NT 5A 10/2023 CALL 106.5	USD	540	11 954,21	0,00
CBOT US TRES NT 5A 11/2023 CALL 107	USD	1 440	371 900,83	0,13
CBOT US TRES NT 5A 11/2023 CALL 108	USD	-2 160	-262 987,01	-0,09
CBOT US TRES NT 5A 11/2023 PUT 104	USD	-504	-133 884,30	-0,04
DJES BANKS 10/2023 PUT 100	EUR	3 900	34 125,00	0,01
DJES BANKS 12/2023 CALL 120	EUR	3 250	215 312,50	0,08
DJES BANKS 12/2023 CALL 125	EUR	-6 500	-162 500,00	-0,06
DJES BANKS 12/2023 CALL 130	EUR	3 250	32 500,00	0,01
EUREX EURO BUND 10/2023 CALL 130	EUR	360	0,00	0,00
EUREX EURO BUND 10/2023 CALL 131	EUR	-360	0,00	0,00
EUR MID-CURVE 12/2023 CALL 100	EUR	-1 080	18 000,00	0,01
EUR MID-CURVE 12/2023 CALL 97.5	EUR	1 080	6 750,00	0,00
LIFFE 3M EURIBOR 12/2023 CALL 100	EUR	-1 440	9 000,00	0,01
LIFFE 3M EURIBOR 12/2023 CALL 97.5	EUR	1 440	-81 000,00	-0,03
SOFFRATE 12/2023 CALL 97	USD	540	22 314,05	0,00
SOFFRATE 12/2023 CALL 97.75	USD	-1 080	-15 938,61	0,00
SOFFRATE 12/2023 CALL 98.5	USD	540	7 969,30	0,00
SONIA 3M 12/2023 CALL 97	GBP	360	-20 751,67	-0,01
SONIA 3M 12/2023 CALL 98	GBP	-720	10 375,84	0,01
SONIA 3M 12/2023 CALL 99	GBP	360	-10 375,84	-0,01
TOTAL Engagements à terme conditionnels sur marché réglementé			76 318,04	0,03
Engagements à terme conditionnels sur marché de gré à gré				
EURHUF C 475 10/23	EUR	-250 000	0,00	0,00
EURHUF P 400 10/23	EUR	1 250 000	996 462,50	0,34
EURUSD C 1.2 10/23	EUR	48 750 000	0,00	0,00
EURUSD C 1.25 10/23	EUR	48 750 000	0,00	0,00
EURUSD C 1.25 10/23	EUR	-97 500 000	0,00	0,00
EURUSD C 1.3 10/23	EUR	48 750 000	0,00	0,00
NZDUSD C 0.68 10/23	NZD	49 500 000	0,01	0,00
NZDUSD C 0.7 10/23	NZD	-49 500 000	0,00	0,00
USDJPY P 120 10/23	USD	-33 000 000	0,00	0,00
USDJPY P 130 10/23	USD	33 000 000	0,00	0,00
USDJPY P 130 12/23	USD	-48 500 000	-20 448,45	-0,01
USDJPY P 135 12/23	USD	48 500 000	44 683,70	0,02
USDJPY P 140 10/23	USD	48 750 000	2 232,68	0,00
USDJPY P 145 10/23	USD	48 750 000	40 784,44	0,01
USDZAR C 21 12/23	USD	-8 000 000	-23 634,11	0,00
TOTAL Engagements à terme conditionnels sur marché de gré à gré			1 040 080,77	0,36
TOTAL Engagements à terme conditionnels			1 116 398,81	0,39

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/09/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Autres instruments financiers à terme				
CFD				
CFD ASHM ASHMO 1230	GBP	-24 959	1 784,02	0,00
CFD BEI BEIERS 1230	EUR	-2 755	-3 719,25	0,00
CFD BMY BRISTO 1230	USD	8 508	-29 009,57	-0,01
CFD CBK COMMZB 1230	EUR	16 473	10 542,72	0,00
CFD CFD89A 1230	USD	2 823	-21 357,48	-0,01
CFD CFD NX ROYA 1230	USD	-491	3 153,53	0,00
CFD ELISA ELIS 1230	EUR	-1 567	2 162,46	0,01
CFD EMSN MES NA 1230	CHF	-127	5 441,64	0,00
CFD GIVN GIVAU 1230	CHF	-45	-2 137,22	0,00
CFD JMT JERONI 1230	EUR	-3 395	7 604,80	0,01
CFD KNEBV KONE 1230	EUR	-3 607	7 502,56	0,00
CFD KNIN KUEHN 1230	CHF	-1 088	6 934,47	0,00
CFD KPN KONINK 1230	EUR	44 194	-5 365,15	0,00
CFD LISN LINDT 1230	CHF	-3	11 770,17	0,01
CFD MONC MONCL 1230	EUR	4 382	-33 127,92	-0,01
CFD NA AMERICAN 1230	USD	-407	1 233,97	0,00
CFD NA ASCENTIA 1230	GBP	45 075	4 769,26	0,00
CFD NA BANCO EU 1230	EUR	244 266	7 938,65	0,00
CFD NA BARRY CH 1230	CHF	-26	2 254,92	0,00
CFD NA BLACKROC 1230	USD	-2 129	108 687,08	0,04
CFD NA BMW 1230	EUR	38 021	-30 036,59	-0,01
CFD NA CAESARS 1230	USD	-839	7 060,68	0,00
CFD NA CARREFOU 1230	EUR	12 988	-17 988,38	0,00
CFD NA COMPASS 1230	GBP	7 565	-5 948,85	-0,01
CFD NA FORDMOTO 1230	USD	16 420	4 497,57	0,01
CFD NA HANNOVER 1230	EUR	665	-3 083,01	0,00
CFD NA INFORMA 1230	GBP	18 294	4 133,76	0,01
CFD NA MAN GROU 1230	GBP	-12 690	-1 711,70	0,00
CFD NA OCCIDENT 1230	USD	-1 006	-1 985,87	0,00
CFD NA SWISS CH 1230	CHF	-1 447	-2 011,06	0,00
CFD NAT ABBVIE 1230	USD	3 612	7 164,30	0,00
CFD NAT ACCOR S 1230	EUR	12 908	-23 791,32	-0,01
CFD NAT ASSOCIA 1230	GBP	-6 142	3,95	0,00
CFD NAT BZU EUR 1230	EUR	-9 666	16 432,20	0,00
CFD NAT CAPC GB 1230	GBP	210 762	-6 803,48	0,00
CFD NAT DAXR GB 1230	GBP	14 848	-18 641,27	-0,01
CFD NAT ELM GBP 1230	GBP	100 679	11 606,99	0,00
CFD NAT HARGREA 1230	GBP	-7 717	-1 067,60	0,00
CFD NATI LVMH M 1230	EUR	788	-51 850,40	-0,01
CFD NATIXIS INT 1230	GBP	6 859	-4 852,73	0,00
CFD NAT LAFARGE 1230	CHF	-7 612	-1 729,02	0,00
CFD NAT LAND GB 1230	GBP	8 186	-1 207,99	0,00
CFD NAT RENAULT 1230	EUR	141 342	217 666,68	0,08
CFD NAT TELECOM 1230	EUR	385 426	3 700,09	0,00

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/09/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD NATX ABB LT 1230	CHF	17 344	-15 937,39	-0,01
CFD NATX ABN AM 1230	EUR	19 045	-442,74	0,00
CFD NATX ABRDN 1230	GBP	-68 370	7 369,84	0,00
CFD NATX ACCENT 1230	USD	-535	8 418,51	0,00
CFD NATX ACUITY 1230	USD	563	4 801,79	0,00
CFD NATX ADIDAS 1230	EUR	-892	15 877,60	0,01
CFD NATX ADOBE 1230	USD	-160	7 471,45	0,00
CFD NATX AES CO 1230	USD	-1 697	4 375,74	0,01
CFD NATX AGEAS 1230	EUR	968	2 274,80	0,00
CFD NATX AIXTRO 1230	EUR	3 644	-1 020,32	0,00
CFD NATX AKER B 1230	NOK	4 189	2 751,52	0,00
CFD NATX AKZO N 1230	EUR	-1 009	6 619,04	0,00
CFD NATX ALASKA 1230	USD	-1 327	6 128,95	0,01
CFD NATX ALBEMA 1230	USD	1 543	-40 647,09	-0,02
CFD NATX ALLEGI 1230	USD	-1 153	10 465,48	0,00
CFD NATX ALLIAN 1230	EUR	-1 398	-1 887,30	0,00
CFD NATX ALPHAB 1230	USD	8 689	-43 578,36	-0,01
CFD NATX AMERIC 1230	USD	-471	6 632,93	0,00
CFD NATX AMUNDI 1230	EUR	-5 561	9 453,70	0,00
CFD NATX ANGLO 1230	GBP	18 106	24 539,39	0,01
CFD NATX ANTOFA 1230	GBP	24 374	-5 339,01	-0,01
CFD NATX APA CO 1230	USD	-1 159	2 999,44	0,00
CFD NATX ARCELO 1230	EUR	2 763	2 167,85	0,00
CFD NATX ARTISA 1230	USD	-727	686,66	0,00
CFD NATX ASHTEA 1230	GBP	12 957	-59 983,43	-0,02
CFD NATX ASML H 1230	EUR	520	-26 648,51	-0,01
CFD NATX ASSICU 1230	EUR	5 351	1 257,49	0,01
CFD NATX ATLAS 1230	SEK	-14 549	-227,55	0,00
CFD NATX AUT DA 1230	USD	-245	3 246,61	0,00
CFD NATX AXA 1230	EUR	44 351	17 962,16	0,00
CFD NATX AZIMUT 1230	EUR	-1 226	858,20	0,00
CFD NATX BABCOG 1230	GBP	54 146	16 854,30	0,01
CFD NATX BALLAR 1230	USD	13 341	-6 678,38	0,00
CFD NATX BANCA 1230	EUR	-2 359	471,80	0,00
CFD NATX BANCO 1230	EUR	69 923	1 153,73	0,00
CFD NATX BANKIN 1230	EUR	33 852	4 333,06	0,00
CFD NATX BARCLA 1230	GBP	57 109	7 624,19	0,00
CFD NATX BNP PA 1230	EUR	7 358	5 297,76	0,01
CFD NATX BOEING 1230	USD	-356	10 877,54	0,01
CFD NATX BORG W 1230	USD	6 143	-2 204,81	0,00
CFD NATX BP PLC 1230	GBP	66 395	18 559,19	0,01
CFD NATX BRENNT 1230	EUR	1 674	-2 109,24	0,00
CFD NATX BT GRO 1230	GBP	170 374	-2 598,48	0,00
CFD NATX CARNIV 1230	USD	-1 503	2 981,16	0,00
CFD NATX CELLNE 1230	EUR	-5 214	12 148,62	0,00
CFD NATX CENTER 1230	USD	-1 713	1 682,66	0,01
CFD NATX CIE FI 1230	CHF	3 732	-52 403,28	-0,02

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/09/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD NATX CLARIA 1230	CHF	12 132	-3 047,12	0,00
CFD NATX CMS EN 1230	USD	-562	1 634,91	0,01
CFD NATX COCA-C 1230	USD	-4 731	16 864,59	0,01
CFD NATX COLGAT 1230	USD	-1 246	2 754,98	0,00
CFD NATX COLOPL 1230	DKK	-724	3 650,58	0,00
CFD NATX COMCAS 1230	USD	16 023	-36 624,00	-0,01
CFD NATX COMPAG 1230	EUR	-8 009	19 333,27	0,01
CFD NATX CONSOL 1230	USD	-419	1 357,42	0,00
CFD NATX CONTIN 1230	EUR	2 052	-1 595,22	0,00
CFD NATX CONVAT 1230	GBP	103 924	-17 438,61	0,00
CFD NATX COPART 1230	USD	4 696	-7 079,30	0,00
CFD NATX COSTCO 1230	USD	-1 606	-23 556,26	0,00
CFD NATX COTERR 1230	USD	10 094	-9 905,29	0,00
CFD NATX CREDIT 1230	EUR	10 696	385,06	0,00
CFD NATX CROWN 1230	USD	-334	2 672,00	0,00
CFD NATX DAIMLE 1230	EUR	70 097	-115 660,05	-0,04
CFD NATX DANONE 1230	EUR	4 295	-4 563,71	-0,01
CFD NATX DARDEN 1230	USD	-494	5 734,37	0,00
CFD NATX DASSAU 1230	EUR	-5 660	7 442,90	0,01
CFD NATX DAVIDE 1230	EUR	-12 143	10 989,42	0,00
CFD NATX DELTA 1230	USD	-1 869	10 379,90	0,01
CFD NATX DEUTSC 1230	EUR	17 009	2 143,13	0,00
CFD NATX DEVON 1230	USD	-1 409	4 511,46	0,00
CFD NATX DIAMON 1230	USD	-275	-805,19	0,00
CFD NATX DOMINI 1230	USD	-682	2 492,88	0,00
CFD NATX DR HOR 1230	USD	3 272	-35 694,55	-0,02
CFD NATX DSM-FI 1230	EUR	-1 114	5 592,28	0,00
CFD NATX DS SMI 1230	GBP	86 612	-24 639,22	-0,01
CFD NATX DSV PA 1230	DKK	780	660,51	0,00
CFD NATX DUKE E 1230	USD	-426	217,28	0,00
CFD NATX DUPONT 1230	USD	-994	2 159,34	0,00
CFD NATX EDENRE 1230	EUR	2 553	1 123,32	0,00
CFD NATX EDISON 1230	USD	-917	4 815,60	0,00
CFD NATX EDP-EN 1230	EUR	130 945	-35 355,15	-0,01
CFD NATX EDP RE 1230	EUR	42 659	-59 296,01	-0,02
CFD NATX EDWARD 1230	USD	-1 260	8 556,69	0,01
CFD NATX ELI LI 1230	USD	-1 044	17 595,00	0,00
CFD NATX ELIOR 1230	EUR	44 381	-4 906,41	0,00
CFD NATX ENCAVI 1230	EUR	3 820	-3 208,80	0,00
CFD NATX ENEL 1230	EUR	202 558	-78 997,62	-0,03
CFD NATX ENERSY 1230	USD	803	-7 819,53	-0,01
CFD NATX ENI 1230	EUR	13 690	4 306,46	0,01
CFD NATX ENPHAS 1230	USD	812	-4 893,09	0,00
CFD NATX ENTERG 1230	USD	-417	1 083,12	0,00
CFD NATX EQUINO 1230	NOK	1 884	-768,97	0,00
CFD NATX EVERGY 1230	USD	-693	2 788,36	0,00
CFD NATX EXELON 1230	USD	-958	2 108,28	0,00

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/09/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD NATX EXPEDI 1230	USD	-353	1 773,75	0,00
CFD NATX FASTEN 1230	USD	-5 036	13 984,26	0,00
CFD NATX FERGUS 1230	GBP	-1 250	-15 458,04	-0,01
CFD NATX FIAT C 1230	EUR	211 805	223 666,08	0,07
CFD NATX FIRST 1230	USD	1 481	-38 509,50	-0,01
CFD NATX FIRSTE 1230	USD	-874	1 560,20	0,00
CFD NATX FORTIS 1230	CAD	2 046	-2 001,12	0,00
CFD NATX FORTUM 1230	EUR	8 410	-11 816,05	0,00
CFD NATX FRANKL 1230	USD	-10 500	21 421,49	0,01
CFD NATX FREENE 1230	EUR	5 854	468,32	0,00
CFD NATX FRESEN 1230	EUR	4 571	-685,65	0,00
CFD NATX FUELCE 1230	USD	11 139	-1 262,51	0,00
CFD NATX GAP IN 1230	USD	-1 284	1 152,11	0,00
CFD NATX GEBERI 1230	CHF	-196	-80,95	0,00
CFD NATX GENERA 1230	USD	10 902	-5 560,41	-0,01
CFD NATX GILEAD 1230	USD	2 864	-4 165,82	0,00
CFD NATX GLENCO 1230	GBP	34 017	5 798,03	0,01
CFD NATX GOLDMA 1230	USD	1 877	-7 339,58	0,00
CFD NATX HEIDEL 1230	EUR	-6 471	4 917,96	0,01
CFD NATX HEINEK 1230	EUR	-1 509	9 597,24	0,00
CFD NATX HERMES 1230	EUR	126	-18 586,98	-0,01
CFD NATX HEXCEL 1230	USD	2 422	-18 666,84	-0,01
CFD NATX HILTON 1230	USD	-472	-682,09	0,00
CFD NATX HOWMET 1230	USD	-1 988	6 046,15	0,00
CFD NATX IDEXX 1230	USD	-166	11 624,31	0,01
CFD NATX ILLINO 1230	USD	-1 282	20 633,09	0,00
CFD NATX ING GR 1230	EUR	26 765	-13 223,43	-0,01
CFD NATX INTERC 1230	GBP	-4 186	-4 940,04	0,00
CFD NATX INTERC 1230	USD	-796	5 529,01	0,00
CFD NATX INTESA 1230	EUR	91 466	-2 926,91	-0,01
CFD NATX IPSEN 1230	EUR	2 002	8 808,80	0,00
CFD NATX IRON M 1230	USD	-1 496	5 779,12	0,00
CFD NATX ITRON 1230	USD	2 876	-21 269,50	-0,01
CFD NATX ITV PL 1230	GBP	206 131	-427,76	-0,01
CFD NATX JANUS 1230	USD	-1 307	2 036,88	0,00
CFD NATX JOHNSO 1230	USD	2 770	-15 305,31	0,00
CFD NATX KBC GR 1230	EUR	1 488	-2 112,96	0,00
CFD NATX KB HOM 1230	USD	1 008	-4 303,34	0,00
CFD NATX KERING 1230	EUR	1 109	-69 090,70	-0,03
CFD NATX KINDER 1230	USD	-4 276	2 584,78	0,00
CFD NATX L' AIR 1230	EUR	-5 666	38 239,86	0,02
CFD NATX LEGAL 1230	GBP	-77 261	1 452,41	0,00
CFD NATX LEG IM 1230	EUR	-1 057	1 331,82	0,00
CFD NATX LEGRAN 1230	EUR	1 760	-6 688,00	0,00
CFD NATX LENNAR 1230	USD	3 069	-19 885,09	-0,01
CFD NATX LLOYDS 1230	GBP	112 337	2 609,63	0,00
CFD NATX LONZA 1230	CHF	-140	9 149,76	0,01

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/09/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD NATX L OREA 1230	EUR	-8 558	107 830,80	0,04
CFD NATX LUMEN TECH	USD	-6 135	985,08	0,00
CFD NATX MARATH 1230	USD	-470	-3 804,39	0,00
CFD NATX MASTER 1230	USD	-805	13 111,19	0,00
CFD NATX MCDONA 1230	USD	-938	15 414,36	0,00
CFD NATX MDC HO 1230	USD	1 104	-6 485,84	-0,01
CFD NATX MERCK 1230	USD	4 749	-27 047,43	-0,01
CFD NATX MERITA 1230	USD	374	-5 881,56	-0,01
CFD NATX META P 1230	USD	2 441	9 959,97	0,00
CFD NATX MGM RE 1230	USD	-778	5 305,46	0,01
CFD NATX MICRON 1230	USD	4 445	-8 018,84	-0,01
CFD NATX MICROS 1230	USD	1 514	-17 174,16	-0,01
CFD NATX MUNICH 1230	EUR	32	348,80	0,00
CFD NATX NEL AS 1230	NOK	38 474	-11 256,02	0,00
CFD NATX NEOEN 1230	EUR	6 041	-724,92	0,00
CFD NATX NEWMON 1230	USD	3 461	-8 074,30	0,00
CFD NATX NEXTER 1230	USD	-768	6 898,40	0,01
CFD NATX NIKE I 1230	USD	1 467	-8 438,28	0,00
CFD NATX NISOUR 1230	USD	-2 455	4 823,05	0,00
CFD NATX NORDEX 1230	EUR	10 825	6 495,00	0,00
CFD NATX NOVO N 1230	DKK	-5 988	-3 524,80	0,00
CFD NATX NVR IN 1230	USD	45	-17 597,50	-0,01
CFD NATX OMV AG 1230	EUR	687	1 751,85	0,00
CFD NATX ORANGE 1230	EUR	-3 274	1 304,03	0,00
CFD NATX ORSTED 1230	DKK	6 259	-48 178,44	-0,02
CFD NATX PAYCHE 1230	USD	-1 014	6 608,36	0,00
CFD NATX PENN N 1230	USD	-1 533	1 071,47	0,00
CFD NATX PEPSIC 1230	USD	-1 538	12 315,97	0,00
CFD NATX PFIZER 1230	USD	13 841	-28 891,25	-0,01
CFD NATX PINNAC 1230	USD	-521	1 766,60	0,00
CFD NATX PLUG P 1230	USD	4 985	-4 049,21	0,00
CFD NATX POOL 1230	USD	-175	1 570,25	0,01
CFD NATX PORS A 1230	EUR	22 923	-66 935,16	-0,02
CFD NATX POSTE 1230	EUR	3 173	-910,65	0,00
CFD NATX PPL CO 1230	USD	-1 522	1 955,06	0,00
CFD NATX PROCTE 1230	USD	-2 585	20 685,18	0,00
CFD NATX PROXIM 1230	EUR	7 610	5 479,20	0,00
CFD NATX PRUDEN 1230	GBP	26 639	-13 489,65	0,00
CFD NATX REGENE 1230	USD	350	-1 166,94	0,00
CFD NATX REMY C 1230	EUR	-161	4 395,30	0,00
CFD NATX REPSOL 1230	EUR	-9 564	-9 226,39	-0,01
CFD NATX REPUB 1230	USD	-620	2 041,56	0,00
CFD NATX ROLLIN 1230	USD	-3 758	7 950,81	0,00
CFD NATX RWE AG 1230	EUR	10 345	-30 103,95	-0,01
CFD NATX SANOFI 1230	EUR	1 749	4 967,16	0,00
CFD NATX SARTOR 1230	EUR	437	-20 477,95	-0,01
CFD NATX SBA CO 1230	USD	-237	5 452,96	0,01

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/09/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD NATX SCATEC 1230	NOK	10 869	-7 718,09	0,00
CFD NATX SCHLUM 1230	USD	-1 761	1 097,77	0,00
CFD NATX SCHNEI 1230	EUR	3 850	-6 160,00	0,00
CFD NATX SEVERN 1230	GBP	9 224	-3 721,93	-0,01
CFD NATX SGL CA 1230	EUR	6 373	-2 485,47	0,00
CFD NATX SHELL 1230	EUR	9 043	16 807,73	0,00
CFD NATX SHELL 1230	GBP	14 261	1 214,16	0,00
CFD NATX SHERWI 1230	USD	-676	10 643,61	0,01
CFD NATX SIEMEN 1230	EUR	1 565	-5 039,30	0,00
CFD NATX SIGNIF 1230	EUR	2 738	-1 724,94	0,00
CFD NATX SMITH 1230	GBP	14 256	-7 250,86	0,00
CFD NATX SOCIET 1230	EUR	45 848	-96 167,49	-0,03
CFD NATX SODEXO 1230	EUR	-3 185	12 704,03	0,00
CFD NATX SOLARI 1230	EUR	24 876	22 637,16	0,01
CFD NATX SOUTHE 1230	USD	-688	1 955,97	0,00
CFD NATX SOUTHW 1230	USD	-1 533	6 559,14	0,00
CFD NATX SSE PL 1230	GBP	27 034	-5 142,51	0,00
CFD NATX SUNPOW 1230	USD	6 391	-5 976,00	0,00
CFD NATX SUNRUN 1230	USD	5 388	-15 623,29	-0,01
CFD NATX SWATCH 1230	CHF	1 018	-13 979,04	-0,01
CFD NATX TATE & 1230	GBP	58 835	-15 577,38	-0,01
CFD NATX TAYLOR 1230	USD	1 416	-6 406,27	0,00
CFD NATX TERADY 1230	USD	-617	4 289,13	0,00
CFD NATX TEXAS 1230	USD	-186	1 589,89	0,00
CFD NATX TOLL B 1230	USD	1 723	-12 970,30	0,00
CFD NATX TOTAL 1230	EUR	7 482	1 416,81	0,00
CFD NATX TRI PO 1230	USD	1 605	-5 684,77	0,00
CFD NATX T ROWE 1230	USD	-5 858	40 722,44	0,01
CFD NATX UNILEV 1230	GBP	3 791	-2 418,34	0,00
CFD NATX UNITED 1230	USD	237	-7 156,45	0,00
CFD NATX UNITED 1230	USD	-767	5 440,54	0,01
CFD NATX VALERO 1230	USD	-523	-5 833,89	-0,01
CFD NATX VEOLIA 1230	EUR	35 144	-50 255,92	-0,02
CFD NATX VERBUN 1230	EUR	3 978	5 768,10	0,00
CFD NATX VESTAS 1230	DKK	14 721	-14 647,96	-0,01
CFD NATX VOLKSW 1230	EUR	35 796	-146 191,62	-0,06
CFD NATX WALMAR 1230	USD	-5 342	13 568,14	0,00
CFD NATX WASTE 1230	USD	-576	2 567,57	0,00
CFD NATX WEIR G 1230	GBP	17 865	5 063,13	0,00
CFD NATX WESTRO 1230	USD	-796	-2 323,15	0,00
CFD NATX WHITBR 1230	GBP	4 113	1 138,02	0,00
CFD NATX WILLIA 1230	USD	-1 189	943,34	0,00
CFD NATX WISDOM 1230	USD	-6 963	1 972,99	0,01
CFD NATX WOLFSP 1230	USD	1 692	-15 533,64	-0,01
CFD NATX WYNN R 1230	USD	-745	6 311,83	0,01
CFD NATX YUM! B 1230	USD	-576	2 415,53	0,01
CFD NATX ZUMTOB 1230	EUR	5 498	-5 223,10	0,00

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/09/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD NATX ZURICH 1230	CHF	317	-1 238,54	0,00
CFD NA UNICREDI 1230	EUR	57 162	9 431,73	0,01
CFD NESN NESTL 1230	CHF	-20 739	57 580,30	0,02
CFD NOVN NOVAR 1230	CHF	2 506	11 798,42	0,00
CFD NTX KOJAMO 1230	EUR	-8 804	7 043,20	0,01
CFD PGHN PARTN 1230	CHF	91	7 450,62	0,00
CFD RIO TINTO N 1230	GBP	9 532	8 650,97	0,01
CFD RI RICARD N 1230	EUR	-2 260	52 771,00	0,01
CFD ROR ROTORK 1230	GBP	71 948	9 610,54	0,00
CFD SCHP SCHIN 1230	CHF	-572	8 356,62	0,00
CFD SGE SAGE NA 1230	GBP	17 067	3 541,69	0,00
CFD TEL2B TELE 1230	SEK	-20 258	3 233,35	0,00
CFD WKL WOLTER 1230	EUR	-2 984	-6 787,16	0,00
NAT IBERDROLA 1230	EUR	42 404	-15 477,46	-0,01
NATI KINGFISHER 1230	GBP	81 022	-9 163,53	0,00
NATX BPER BAN 1230	EUR	48 374	5 272,77	0,01
NATX BURBERRY 1230	GBP	12 234	-38 218,75	-0,02
NATX LIVE NAT 1230	USD	-274	385,61	0,01
NATX MICHELIN 1230	EUR	-4 646	3 338,15	0,00
NATX QUILTER 1230	GBP	109 527	189,41	0,00
NATX SCHRODER 1230	GBP	-18 873	1 000,88	0,00
NATX SGS SA-REG 1230	CHF	-3 864	13 041,40	0,01
NATX STRAUMAN 1230	CHF	869	-13 832,52	-0,01
TELEFONICA JP 1230	EUR	16 928	-1 474,43	0,00
TOTAL CFD			-332 916,80	-0,11
TOTAL Autres instruments financiers à terme			-332 916,80	-0,11
TOTAL Instrument financier à terme			11 593 650,59	4,01
Appel de marge				
APPEL MARGE CACEIS	CHF	-8 820	-9 106,40	0,00
APPEL MARGE CACEIS	USD	-9 034 622,21	-8 533 291,34	-2,95
APPEL MARGE CACEIS	JPY	-114 350 135	-723 771,91	-0,25
APPEL MARGE CACEIS	EUR	-2 874 520,5	-2 874 520,50	-0,99
APPEL MARGE CACEIS	GBP	78 260	90 223,66	0,02
TOTAL Appel de marge			-12 050 466,49	-4,17
Créances			2 089 664 074,56	722,02
Dettes			-2 042 586 189,97	-705,75
Comptes financiers			14 733 615,03	5,09
Actif net			289 420 363,11	100,00



H2O
Asset Management

H2O AM EUROPE

Société de gestion de portefeuille agréée par l'Autorité des Marchés Financiers sous le numéro GP-19000011
Société par actions simplifiée immatriculée au RCS de Paris sous le N° 843 082 538
39 avenue Pierre 1er de Serbie - 75008 Paris - France