



H2O
Asset Management

OPCVM de droit français

H2O MODERATO FCP

PUBLICATION SEMESTRIELLE

au 31 mars 2021

Société de gestion : H2O AM EUROPE

Dépositaire : CACEIS Bank

Commissaire aux comptes : KPMG Audit

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

Société anonyme par actions simplifiée autorisée par l'Autorité des marchés financiers,
sous le numéro GP 19000011

www.h2o-am.com

Commercialisateur :

Natixis Investment Managers International 43 avenue Pierre Mendès France - 75013 Paris France -

Tél. : +33 (0)1 78 40 80 00

www.im.natixis.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	692 439 837,60
b) Avoirs bancaires	100 044 800,00
c) Autres actifs détenus par l'OPC	2 169 265 602,68
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	2 961 750 240,28
e) Passif	-1 977 732 081,01
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	984 018 159,27

* 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 MODERATO HCHF-I(C) en CHF	C	3 541 900,01	64,8742	54 596,43
H2O MODERATO HCHF-R(C) en CHF	C	1 691 256,69	10 300,4274	164,19
H2O MODERATO HCHF-SR(C) en CHF	C	144 438,53	1 488,2664	97,05
H2O MODERATO HCHF-N(C) en CHF	C	54 393,15	524,9000	103,62
H2O MODERATO HGBP-I(C) en GBP	C	73 411,65	845,0000	86,87
H2O MODERATO HUSD-I(C) en USD	C	1 867 680,43	34,1866	54 631,94
H2O MODERATO HUSD-R(C) en USD	C	362 378,94	2 811,4797	128,89
H2O MODERATO HUSD-SR(C) en USD	C	354 071,27	3 676,0313	96,31
H2O MODERATO EUR-I(C) en EUR	C	38 363 582,37	434,1385	88 367,15
H2O MODERATO EUR-N(C) en EUR	C	5 421 042,88	54 506,8760	99,45
H2O MODERATO EUR-R(C) en EUR	C	616 132 391,94	3 742 917,1578	164,61
H2O MODERATO EUR-SR(C) en EUR	C	316 905 548,36	3 316 228,4406	95,56

● 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.	45,26	15,04
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.	25,11	8,34
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.	5,82	1,93

* 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 **
Euro	EUR	427 393 059,65	43,43	14,43
Dollar Us	USD	98 219 035,24	9,98	3,32
Yen Japonnais	JPY	84 405 370,03	8,58	2,85
Rand	ZAR	33 698 057,57	3,42	1,14
Rouble Russe	RUB	31 801 674,99	3,23	1,07
Livre Sterling	GBP	11 802 218,96	1,20	0,40
Peso Mexicain	MXN	4 954 576,69	0,50	0,17
Dollar Canadien	CAD	165 844,47	0,02	0,01
TOTAL		692 439 837,60	70,37	23,38

* 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	11,76	3,91
ITALIE	8,62	2,87
JAPON	8,58	2,85
BELGIQUE	6,80	2,26
ALLEMAGNE	6,57	2,18
TURQUIE	5,18	1,72
PAYS-BAS	4,63	1,54
MEXIQUE	3,59	1,19
AFRIQUE DU SUD	3,42	1,14
RUSSIE	3,23	1,07
GRECE	3,17	1,05
ESPAGNE	2,40	0,80
ROYAUME-UNI	1,20	0,40
ETATS-UNIS	1,09	0,36
PORTUGAL	0,09	0,03
CANADA	0,02	0,01
TOTAL	70,37	23,38

* 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	5,35	1,78
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	0,47	0,15
Autres actifs		
Autres		
TOTAL	5,82	1,93

* 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.	624 080 923,84	816 175 831,98
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.	192 964 211,27	171 403 071,13
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.		20 603 779,05

● 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 :

H2O AM EUROPE - 39 avenue Pierre 1^{er} de Serbie - 75008 - Paris

• **TRANSPARENCE DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA RÉUTILISATION DES INSTRUMENTS FINANCIERS - RÈGLEMENT SFTR - EN DEVISE DE COMPTABILITÉ DE L'OPC (EUR)**

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

a) Titres et matières premières prêtés

Montant					
% de l'Actif Net*					

*% hors trésorerie et équivalent de trésorerie

b) Actifs engagés pour chaque type d'opérations de financement sur titres et TRS exprimés en valeur absolue

Montant					
% de l'Actif Net					

c) 10 principaux émetteurs de garanties reçues (hors cash) pour tous les types d'opérations de financement

--	--	--	--	--	--

d) 10 principales contreparties en valeur absolue des actifs et des passifs sans compensation

--	--	--	--	--	--

e) Type et qualité des garanties (collatéral)

Type					
- Actions					
- Obligations					
- OPC					
- TCN					
- Cash					
Rating					
Monnaie de la garantie					
Euro					

f) Règlement et compensation des contrats

Triparties				X	
Contrepartie centrale					
Bilatéraux	X			X	

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

g) Échéance de la garantie ventilée en fonction des tranches

Moins d'1 jour					
1 jour à 1 semaine					
1 semaine à 1 mois					
1 à 3 mois					
3 mois à 1 an					
Plus d'1 an					
Ouvertes					

h) Échéance des opérations de financement sur titres et TRS ventilée en fonction des tranches

Moins d'1 jour					
1 jour à 1 semaine					
1 semaine à 1 mois					
1 à 3 mois					
3 mois à 1 an					
Plus d'1 an					
Ouvertes					

i) Données sur la réutilisation des garanties

Montant maximal (%)					
Montant utilisé (%)					
Revenus pour l'OPC suite au réinvestissement des garanties espèces en euros					

j) Données sur la conservation des garanties reçues par l'OPC

CACEIS Bank					
Titres					
Cash					

k) Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC

Titres					
Cash					

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

I) Données sur les revenus et les coûts ventilés

Revenus					
- OPC				71 946,36	
- Gestionnaire					
- Tiers					
Coûts					
- OPC				437 037,21	
- Gestionnaire					
- Tiers					

e) Données Type et qualité des garanties (collatéral)

Le collatéral reçu doit être conforme à la politique de H2O définie afin de garantir un haut niveau de qualité et de liquidité ainsi qu'une absence de corrélation directe avec la contrepartie de l'opération. En complément, la politique de collatéralisation de H2O définit des niveaux de sur-collatéralisation adaptés à chaque type de titres pour faire face le cas échéant à la variation de leur valeur. Enfin un dispositif d'appel de marges quotidien est en place afin de compenser les variations de mark to market des titres.

i) Données sur la réutilisation des garanties

Les OPCVM doivent impérativement réinvestir l'intégralité de leurs garanties cash (ie. montant maximal = montant maximal utilisé = 100%), mais ne peuvent réutiliser leurs garanties titres (ie. montant maximal = montant utilisé = 0%).

Par ailleurs, en cas de réception de garanties financières en espèces, celles-ci doivent, dans des conditions fixées par la réglementation, uniquement être :

- placées en dépôts ;
- investies dans des obligations d'Etat de haute qualité ;
- utilisées dans une prise en pension livrée ;
- investies dans des organismes de placement collectif (OPC) monétaire court terme.

Pour les opérations réalisées par H2O, les sommes reçues au titre du collatéral espèces sur les opérations de cessions temporaires de titres sont investies dans des obligations d'Etat de haute qualité.

k) Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC

Toutes les garanties financières fournies par l'OPC sont transférées en pleine propriété.

l) Données sur les revenus et les coûts ventilés

Tous les revenus résultant des opérations d'acquisitions et de cessions temporaires de titres, nets des coûts opérationnels, sont restitués à l'OPCVM.

Les opérations de cessions temporaires de titres sont conclues avec des contreparties de marché et intermédiées par H2O.

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 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				
CANADA				
BALLARD POWER SYSTEMS	CAD	7 993	165 844,47	0,02
TOTAL CANADA			165 844,47	0,02
ETATS-UNIS				
ACUITY BRANDS INC	USD	400	56 155,88	
APPLE INC / EX - APPLE SHS	USD	3 848	399 926,15	0,04
BANK OF NEW YORK MELLON	USD	1 296	52 146,55	0,01
BORGWARNER INC	USD	700	27 611,67	0,01
DISH NETWORK CORP A	USD	1 245	38 346,81	
DR HORTON INC	USD	7 061	535 417,61	0,06
EMERSON ELECTRIC	USD	25 938	1 991 088,54	0,20
ENERSYS INC	USD	10 449	807 257,04	0,08
FORD MOTOR COMPANY	USD	78 988	823 281,72	0,09
HEXCEL CORP	USD	2 618	124 740,92	0,01
IBM	USD	445	50 455,80	0,01
IRON MOUNTAIN REIT	USD	507	15 965,35	
ITRON INC.	USD	501	37 789,20	0,01
JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC	USD	1 969	99 966,16	0,01
KB HOME	USD	1 838	72 766,22	
LENNAR CORP COM	USD	6 660	573 633,80	0,06
MACYS INC.	USD	17 468	240 625,30	0,02
MARRIOTT INTERNATIONAL CL.A	USD	6 514	820 887,04	0,08
M D C HOLDINGS	USD	1 533	77 478,26	
MERITAGE HOMES	USD	706	55 216,13	0,01
NVR	USD	84	336 695,41	0,04
ORACLE CORP COM	USD	14 307	854 183,77	0,09
PFIZER INC	USD	62 540	1 927 868,80	0,19
PLUG POWER INC	USD	4 713	143 719,83	0,01
PULTE GROUP	USD	6 588	293 945,99	0,03
TAYLOR MORRISON HOME CORP	USD	52	1 363,16	
TOLL BROTHERS INC	USD	3 742	180 620,83	0,02
TRI POINTE HOMES INC	USD	3 634	62 952,64	0,01
WHIRLPOOL CORP	USD	87	16 311,11	
TOTAL ETATS-UNIS			10 718 417,69	1,09
JAPON				
HONDA MOTOR CO JPY50	JPY	11 377	290 752,86	0,03
NGK INSULATORS JPY50	JPY	42 895	668 507,32	0,07
TOYOTA MOTOR	JPY	21 326	1 414 829,42	0,14
TOTAL JAPON			2 374 089,60	0,24
MEXIQUE				
URBI DESARROLLOS URBANOS	MXN	820	288,14	
TOTAL MEXIQUE			288,14	
TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			13 258 639,90	1,35

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TOTAL Actions et valeurs assimilées			13 258 639,90	1,35
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
AFRIQUE DU SUD				
REPU SUDA 8.75% 31-01-44	ZAR	729 750 000	33 698 057,57	3,43
TOTAL AFRIQUE DU SUD			33 698 057,57	3,43
ESPAGNE				
BANCO DE SABADELL SA 6.125% PERP	EUR	3 600 000	3 673 498,04	0,38
CAIXABANK 5.25% PERP	EUR	2 600 000	2 752 196,93	0,28
SPAIN GOVERNMENT BOND 1.25% 31-10-30	EUR	8 800 000	9 664 747,07	0,98
TOTAL ESPAGNE			16 090 442,04	1,64
FRANCE				
AXASA 5 1/2 07/22/49	USD	500 000	436 809,99	0,04
SG 7.375% PERP	USD	3 400 000	3 137 644,06	0,32
SOCIETE GENERALE 8.0% PERP	USD	1 700 000	1 699 906,78	0,17
TOTAL FRANCE			5 274 360,83	0,53
GRECE				
GRECE 15/10/2042	EUR	11 150 400	34 566,24	0,01
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 3.75% 29-01-28	EUR	24 162 462	29 635 037,88	3,01
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 3.9% 30-01-33	EUR	61 091	81 304,30	0,01
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 4.0% 30-01-37	EUR	1 068 716	1 486 309,16	0,15
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 4.2% 29-01-42	EUR	156	232,83	
TOTAL GRECE			31 237 450,41	3,18
ITALIE				
BTPS 4 3/4 09/01/44	EUR	9 320 000	15 403 133,61	1,56
ITALIE 6 7/8% 23	USD	2 000 000	1 957 285,37	0,20
UNICREDIT SPA 6.625% PERP	EUR	5 400 000	5 941 072,88	0,61
TOTAL ITALIE			23 301 491,86	2,37
MEXIQUE				
CORPORACION GEO 8.875% 03/22 DEFAULT	USD	1 200 000	112,31	
MEXICAN BONOS 10.0% 05-12-24	MXN	185	902,93	
MEXICAN BONOS 8.5% 18-11-38	MXN	979 300	4 591 772,55	0,47
PEMEX 7.47 11/12/26	MXN	100 000	361 613,07	0,03
PETROLEOS MEXICANOS 6.84% 23-01-30	USD	34 580 000	30 393 210,24	3,09
TOTAL MEXIQUE			35 347 611,10	3,59
PAYS-BAS				
ING GROEP NV 6.875% PERP	USD	4 080 000	3 733 115,91	0,37
TOTAL PAYS-BAS			3 733 115,91	0,37
PORTUGAL				
BCO ESPI 4.75% 15-01-18 EMTN DEFAULT	EUR	1 400 000	230 566,00	0,02
NOVO BAN 0.0% 08-05-17 EMTN DEFAULT	EUR	200 000	35 506,00	
PORTUGAL4.1%06-150437	EUR	420 000	655 644,80	0,07
TOTAL PORTUGAL			921 716,80	0,09
ROYAUME-UNI				
MANSARD MORTGAGES 2006 1 L3RGBP+0.2% 15-10-48	GBP	500 000	45 778,34	

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
UK TREAS 4.25% 07/12/2040	GBP	9 000	16 150,52	0,01
TOTAL ROYAUME-UNI			61 928,86	0,01
RUSSIE				
RUSSIAN FEDERAL BOND OFZ 6.1% 18-07-35	RUB	3 062 143 000	31 801 674,99	3,23
TOTAL RUSSIE			31 801 674,99	3,23
TURQUIE				
REPUBLIQUE DE TURQUIE 3.25% 14-06-25	EUR	4 900 000	4 804 431,21	0,49
REPU DE TURQ 4.875% 09-10-26	USD	23 430 000	18 923 592,45	1,92
TURKEY GOVERNMENT INTL BOND 6.125% 24-10-28	USD	29 090 000	24 138 103,83	2,46
TURKEY GOVERNMENT INTL BOND 7.625% 26-04-29	USD	3 405 000	3 080 836,61	0,31
TOTAL TURQUIE			50 946 964,10	5,18
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			232 414 814,47	23,62
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			232 414 814,47	23,62
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
GERMANY ZCP 09-06-21	EUR	34 690 000	34 735 765,35	3,53
GERM TREA BILL ZCP 05-05-21	EUR	12 984 000	12 992 914,77	1,32
GERM TREA BILL ZCP 29-09-21	EUR	16 884 000	16 940 305,58	1,72
TOTAL ALLEMAGNE			64 668 985,70	6,57
BELGIQUE				
BELGIUM TREASURY BILL 090921 FIX 0.0	EUR	20 300 000	20 356 453,60	2,07
BELG TREA BILL ZCP 15-07-21	EUR	28 500 000	28 553 246,61	2,90
KING OF BELG INFL ZCP 13-05-21	EUR	18 000 000	18 013 356,13	1,83
TOTAL BELGIQUE			66 923 056,34	6,80
ESPAGNE				
SPAI LETR DEL TESO ZCP 16-04-21	EUR	7 500 000	7 501 809,39	0,76
TOTAL ESPAGNE			7 501 809,39	0,76
FRANCE				
FRAN TREA BILL BTF ZCP 08-04-21	EUR	5 900 000	5 900 810,92	0,60
FRAN TREA BILL BTF ZCP 16-06-21	EUR	8 400 000	8 411 380,11	0,85
FRAN TREA BILL BTF ZCP 21-04-21	EUR	32 800 000	32 810 131,77	3,33
FRAN TREA BILL BTF ZCP 27-05-21	EUR	34 750 000	34 783 390,32	3,53
FRENCH REP ZCP 05-05-21	EUR	13 684 000	13 693 015,99	1,39
FRENCH REP ZCP 09-06-21	EUR	8 869 350	8 880 076,58	0,90
FRENCH REP ZCP 28-07-21	EUR	6 000 000	6 012 029,90	0,62
TOTAL FRANCE			110 490 835,59	11,22
ITALIE				
ITAL BUON ORDI DEL ZCP 14-09-21	EUR	18 000 000	18 018 830,46	1,83
ITAL BUON ORDI DEL ZCP 30-04-21	EUR	4 800 000	4 801 957,97	0,49
ITALY BUONI TES BOT ZCP 140521	EUR	11 500 000	11 506 599,88	1,17
TOTAL ITALIE			34 327 388,31	3,49
JAPON				
JAPA TREA DISC BIL ZCP 12-07-21	JPY	10 650 000 000	82 031 280,43	8,33
TOTAL JAPON			82 031 280,43	8,33

● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
PAYS-BAS				
DUTC TREA CERT ZCP 28-05-21	EUR	39 000 000	39 040 390,98	3,97
DUTC TREA CERT ZCP 29-07-21	EUR	2 800 000	2 805 904,13	0,29
TOTAL PAYS-BAS			41 846 295,11	4,26
ROYAUME-UNI				
UK TREASURY BILL ZCP 170521	GBP	10 000 000	11 740 290,10	1,20
TOTAL ROYAUME-UNI			11 740 290,10	1,20
TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			419 529 940,97	42,63
TOTAL Titres de créances			419 529 940,97	42,63
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
H2O GLOBAL CONVERTIBLES IC EUR	EUR	71 000	8 481 660,00	0,86
TOTAL FRANCE			8 481 660,00	0,86
IRLANDE				
H2O Barry Active Val I EUR	EUR	37 500	3 271 125,00	0,33
H2O Barry Short I EUR	EUR	50 086,629	4 249 850,47	0,42
H2O BARRY VOLATIBILITY ARBITRAGE FUND FOUNDER CLASS	EUR	41 459	4 260 326,84	0,44
TOTAL IRLANDE			11 781 302,31	1,19
LUXEMBOURG				
H2O LUX INVEST GLOBAL EM MACRO FUND S ACC	EUR	1 009,968	1 033 338,66	0,11
QUADRA CAPITAL EUROPEAN EQT ALPHA S -A-	EUR	5 740	4 614 213,80	0,47
SATELLITE EVENT-DRIVEN SEEDER	EUR	30 000	26 776 800,00	2,72
TOTAL LUXEMBOURG			32 424 352,46	3,30
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			52 687 314,77	5,35
Autres organismes non européens				
CAIMANES, ILES				
POINCARE GBL EQ MASTER B0918	USD	431,295599	403 786,94	0,04
POINCARE GLOBAL EQUITY MASTER FUND LTD	USD	5 000	4 184 222,84	0,43
TOTAL CAIMANES, ILES			4 588 009,78	0,47
TOTAL Autres organismes non européens			4 588 009,78	0,47
TOTAL Organismes de placement collectif			57 275 324,55	5,82
Titres mis en dépôt				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
BTPS 4 3/4 09/01/44	EUR	16 480 000	27 236 442,26	2,77
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			27 236 442,26	2,77
TOTAL Titres mis en dépôt			27 236 442,26	2,77
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
AEX FUT 0421	EUR	-10	-40 850,00	
CAC 40 FUT 0421	EUR	-18	-1 485,00	
CBOT USUL 30A 0621	USD	751	-2 754 595,90	-0,27
CME SP MID400 0621	USD	22	-56 062,28	

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
DJE 600 EUROP 0621	EUR	1 261	366 917,50	0,04
DJE 600 INDUS 0621	EUR	-32	-9 180,00	
DJES BANKS 0621	EUR	41 240	101 811,83	0,01
DJS A&P FUT 0621	EUR	3 505	8 279 835,00	0,84
DJS BAS R FUT 0621	EUR	24	-7 140,00	
DJS F&B FUT 0621	EUR	-591	-255 790,00	-0,02
DJS TECH FUT 0621	EUR	-1 278	-2 541 390,00	-0,26
DJ STOXX HC 0621	EUR	-103	-101 612,50	-0,01
E-STOXX UTIL 0621	EUR	-22	-9 605,00	
EURO STOXX 50 0621	EUR	-330	-139 950,00	-0,02
FGBL BUND 10A 0621	EUR	-213	-35 895,00	-0,01
FTSE 100 FUT 0621	GBP	457	-293 082,70	-0,03
FV CBOT UST 5 0621	USD	-9 149	10 788 213,59	1,10
LIFFE LG GILT 0621	GBP	-828	1 479 697,13	0,15
MME MSCI EMER 0621	USD	247	44 509,91	
N1 TOKYO NIKK 0621	JPY	-76	-16 208,44	-0,01
NK2 TOKYO NIK 0621	JPY	-135	-256 565,36	-0,03
NQ USA NASDAQ 0621	USD	104	292 876,71	0,03
OMXS30 FUT 0421	SEK	106	26 949,26	
OSFT TOPIX IN 0621	JPY	52	210 666,57	0,02
RTY INDEX 50 0621	USD	-2 937	16 366 442,40	1,67
S&P TORONTO 6 0621	CAD	-1	264,01	
SP 500 MINI 0621	USD	-306	-467 572,11	-0,05
SPI 200 FUT 0621	AUD	5	2 025,14	
ST600 RETAIL 0621	EUR	-202	119 430,00	0,01
TU CBOT UST 2 0621	USD	89	-13 337,68	
TY CBOT YST 1 0621	USD	-1 386	3 515 292,64	0,36
US TBOND 30 0621	USD	-30	123 266,40	0,01
XEUR FGBX BUX 0621	EUR	-109	257 010,00	0,03
XEUR FSMI SWI 0621	CHF	-299	-621 954,53	-0,06
XEUR FSTC DJ 0621	EUR	-46	-94 810,00	-0,01
XEUR FSTU DJ 0621	EUR	203	102 525,00	0,01
XEUR FSTV DJ 0621	EUR	-147	3 665,00	
XEUR FSTZ DJ 0621	EUR	-16	-9 120,00	-0,01
XSFE YT1 AUST 0621	AUD	-1 141	94 468,38	0,01
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			34 449 659,97	3,50
TOTAL Engagements à terme fermes			34 449 659,97	3,50
Engagements à terme conditionnels				
Engagements à terme conditionnels sur marché réglementé				
CBOT US TRES BD 20 A 04/2021 CALL 158	USD	-130	-58 761,59	
CBOT US TRES BD 20 A 04/2021 CALL 160	USD	325	56 169,17	0,01
CBOT US TRES BD 20 A 04/2021 CALL 163	USD	120	5 583,68	
CBOT US TRES BD 20 A 04/2021 PUT 153	USD	-120	-73 385,52	-0,01
CBOT US TRES BD 20 A 05/2021 CALL 160	USD	-254	-123 253,11	-0,01
CBOT US TRES BD 20 A 05/2021 CALL 163	USD	635	122 408,91	0,02

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
DAX Xetra 04/2021 PUT 13750	EUR	-100	-9 350,00	
DAX Xetra 05/2021 CALL 14100	EUR	-100	-525 750,00	-0,05
DAX Xetra 06/2021 CALL 14500	EUR	-100	-406 000,00	-0,04
DJS AUTOMO & PART 06/2021 CALL 580	EUR	-320	-1 204 000,00	-0,12
DJS AUTOMO & PART 06/2021 CALL 690	EUR	-225	-169 312,50	-0,02
EUREX EURO BUND 04/2021 CALL 173.5	EUR	-252	28 980,00	
EUREX EURO BUND 04/2021 CALL 174.5	EUR	630	-28 350,00	-0,01
EUREX EURO BUND 05/2021 CALL 173.5	EUR	70	-12 250,00	-0,01
EUREX EURO BUND 05/2021 CALL 175	EUR	125	-31 250,00	
EUREX EURO BUND 05/2021 PUT 168.5	EUR	-70	19 250,00	
EUREX EURO BUND 05/2021 PUT 169	EUR	-125	-5 000,00	
NASDAQ 100 INDEX 04/2021 CALL 13550	USD	-45	-56 762,10	-0,01
NASDAQ 100 INDEX 04/2021 CALL 13590	USD	-45	-50 061,69	-0,01
NASDAQ 100 INDEX 06/2021 CALL 12200	USD	-9	-181 198,42	-0,02
NASDAQ 100 INDEX 06/2021 CALL 12300	USD	-35	-658 948,78	-0,07
NASDAQ 100 INDEX 06/2021 PUT 11000	USD	-20	-34 459,29	
NIKKEI 225 05/2021 CALL 28625	JPY	-36	-321 550,71	-0,03
NIKKEI 225 06/2021 CALL 28500	JPY	-36	-199 721,80	-0,02
NIKKEI 225 06/2021 CALL 29125	JPY	-36	-299 374,80	-0,03
NIKKEI 225 06/2021 PUT 25750	JPY	-36	-58 211,77	-0,01
RUSSELL 2000 INDEX 04/2021 CALL 2350	USD	-35	-23 823,70	
RUSSELL 2000 INDEX 04/2021 CALL 2370	USD	-18	-8 423,38	
RUSSELL 2000 INDEX 04/2021 PUT 2000	USD	-150	-98 272,78	-0,01
RUSSELL 2000 INDEX 04/2021 PUT 2200	USD	150	608 142,60	0,06
RUSSELL 2000 INDEX 05/2021 CALL 2250	USD	-230	-1 425 636,01	-0,14
RUSSELL 2000 INDEX 05/2021 PUT 1800	USD	-80	-75 555,18	-0,01
RUSSELL 2000 INDEX 05/2021 PUT 1900	USD	-120	-190 419,47	-0,02
RUSSELL 2000 INDEX 05/2021 PUT 2000	USD	80	213 732,66	0,02
RUSSELL 2000 INDEX 05/2021 PUT 2100	USD	120	530 928,27	0,05
RUSSELL 2000 INDEX 06/2021 CALL 2170	USD	-120	-1 387 560,62	-0,14
RUSSELL 2000 INDEX 06/2021 PUT 1900	USD	-120	-304 773,25	-0,04
RUSSELL 2000 INDEX 06/2021 PUT 2100	USD	120	704 500,98	0,08
S&P 500 INDEX 06/2021 PUT 3700	USD	45	107 206,67	0,02
TOTAL Engagements à terme conditionnels sur marché réglementé			-5 624 513,53	-0,57
Engagements à terme conditionnels sur marché de gré à gré				
AUDJPY P 80 04/21	AUD	50 400 000	11 607,93	
AUDJPY P 81 04/21	AUD	-16 800 000	-7 490,82	-0,01
EURJPY P 124 07/21	EUR	25 750 000	85 447,41	0,01
EURPLN P 4.15 05/21	EUR	-120 000 000	-111,43	
EURPLN P 4.3 05/21	EUR	120 000 000	5 898,28	
USDBRL C 6.45 11/21	USD	-12 000 000	-238 008,14	-0,02
TOTAL Engagements à terme conditionnels sur marché de gré à gré			-142 656,77	-0,02
TOTAL Engagements à terme conditionnels			-5 767 170,30	-0,59
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
FIX/3.768/JIBA3R/0.0	ZAR	3 500 000	-5 313,97	
FIX/3.82/JIBA3R/0.0	ZAR	3 200 000	-4 610,33	
FIX/3.825/JIBA3R/0.0	ZAR	4 300 000	-6 163,54	
FIX/3.9/JIBA3R/0.0	ZAR	9 200 000	-12 159,43	
FIX/3.9/JIBA3R/0.0	ZAR	4 000 000	-5 286,71	-0,01
FIX/3.9/JIBA3R/0.0	ZAR	4 900 000	-6 476,22	
FIX/3.91/JIBA3R/0.0	ZAR	5 000 000	-6 533,91	
FIX/3.924/JIBA3R/0.0	ZAR	420 000 000	-422 020,41	-0,04
FIX/3.924/JIBA3R/0.0	ZAR	425 000 000	-427 044,45	-0,05
FIX/3.924/JIBA3R/0.0	ZAR	425 000 000	-427 044,45	-0,05
FIX/3.924/JIBA3R/0.0	ZAR	425 000 000	-427 044,45	-0,05
FIX/3.935/JIBA3R/0.0	ZAR	4 700 000	-5 966,87	
FIX/3.94/JIBA3R/0.0	ZAR	3 000 000	-3 786,30	
FIX/3.965/JIBA3R/0.0	ZAR	2 800 000	-3 429,62	
FIX/3.97/JIBA3R/0.0	ZAR	3 000 000	-3 652,24	
FIX/3.98/JIBA3R/0.0	ZAR	4 000 000	-4 810,10	
FIX/3.98/JIBA3R/0.0	ZAR	3 000 000	-3 607,57	
FIX/3.985/JIBA3R/0.0	ZAR	5 100 000	-6 094,89	
FIX/3.985/JIBA3R/0.0	ZAR	5 300 000	-6 359,47	
FIX/3.99/JIBA3R/0.0	ZAR	3 400 000	-4 037,94	
FIX/4.01/JIBA3R/0.0	ZAR	5 600 000	-6 483,92	
FIX/4.03/JIBA3R/0.0	ZAR	470 000 000	-530 184,61	-0,05
FIX/4.038/JIBA3R/0.0	ZAR	4 000 000	-4 464,55	
FIX/4.0425/JIBA3R/0.0	ZAR	3 900 000	-4 326,79	
FIX/4.045/JIBA3R/0.0	ZAR	3 900 000	-4 312,27	-0,01
FIX/4.075/JIBA3R/0.0	ZAR	5 000 000	-5 305,14	
FIX/4.1/JIBA3R/0.0	ZAR	420 000 000	-432 028,23	-0,04
FIX/4.105/JIBA3R/0.0	ZAR	4 900 000	-4 979,59	
FIX/4.15/JIBA3R/0.0	ZAR	188 300 000	-178 757,49	-0,02
FIX/4.161/JIBA3R/0.0	ZAR	200 000 000	-186 588,00	-0,02
FIX/4.161/JIBA3R/0.0	ZAR	100 000 000	-93 294,01	-0,01
FIX/4.165/JIBA3R/0.0	ZAR	225 000 000	-208 570,39	-0,02
FIX/4.175/JIBA3R/0.0	ZAR	420 000 000	-278 300,32	-0,03
JIBA3R/0.0/FIX/3.915	ZAR	6 000 000	7 869,03	
JIBA3R/0.0/FIX/3.924	ZAR	420 000 000	422 020,41	0,05
JIBA3R/0.0/FIX/4.1	ZAR	425 000 000	437 171,42	0,05
JIBA3R/0.0/FIX/4.1	ZAR	425 000 000	437 171,42	0,05
JIBA3R/0.0/FIX/4.1	ZAR	420 000 000	432 028,23	0,05
JIBA3R/0.0/FIX/4.1	ZAR	425 000 000	437 171,42	0,04
JIBA3R/0.0/FIX/4.362	ZAR	425 000 000	172 976,85	0,02
JIBA3R/0.0/FIX/4.38	ZAR	425 000 000	162 836,20	0,02
JIBA3R/0.0/FIX/4.39	ZAR	425 000 000	157 041,89	0,01
JIBA3R/0.0/FIX/4.397	ZAR	425 000 000	152 698,00	0,02
TOTAL Swaps de taux			-910 053,31	-0,09
CFD				
AMUN AMUND SG 1230	EUR	-7 517	-39 088,40	-0,01

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BIA INT. UBS 1230	EUR	-26 645	-2 930,95	
CDFASHMO 1230	GBP	-55 872	13 773,69	0,01
CFD ACN ACCENT 1230	USD	-5 581	-120 376,37	-0,01
CFD ADP AU DAT 1230	USD	-3 406	-41 875,86	-0,01
CFD AKAM AKAMA 1230	USD	-51 000	-304 978,73	-0,03
CFD ALARCOM CF 1230	USD	7 712	-25 046,12	
CFD AMZN AMAZO 1230	USD	-253	-247,55	
CFD AOS SMITH S 1230	USD	-13 952	-97 817,14	-0,01
CFD ASML HOLD CFD	EUR	1 389	69 464,55	0,01
CFD BAYER AG CFD	EUR	5 447	3 055,22	
CFD BEI BEIERS 1230	EUR	-28 074	-230 206,80	-0,03
CFD BKNG BOOK S 1230	USD	196	4 499,97	
CFD CARLB CARL 1230	DKK	634	-33,23	
CFD CFD BMW 1230	EUR	102 531	1 739 951,07	0,18
CFD CFD NX INSI 1230	USD	-42 686	-403 199,54	-0,04
CFD CFD NX SPLU 1230	USD	-31 200	292 689,53	0,03
CFD CFD SG CHAR 1230	USD	-950	-2 909,90	
CFD CFD SG CMCS 1230	USD	17 333	20 499,34	
CFD CFD SG EMR 1230	USD	-6 485	7 247,00	
CFD CFD SG GRAI 1230	USD	-3 566	-85 622,84	-0,01
CFD CFD SG NEUR 1230	USD	5 000	-565 259,93	-0,06
CFD COTY COTY S 1230	USD	-19 875	-22 660,17	
CFD CRDA CRODA 1230	GBP	-736	-1 555,20	
CFD DGE DIAGEO 1230	GBP	-26 065	-50 996,85	-0,01
CFD DROPBOX NAT 1230	USD	5 000	21 807,20	
CFD DSM KONINK 1230	EUR	386	-813,88	
CFD EDF EDF NAT 1230	EUR	162 763	249 352,92	0,03
CFD EDP 1230	EUR	184 976	593,05	
CFD EL ESTEE SG 1230	USD	-3 929	-16 681,45	
CFD ELISA ELIS 1230	EUR	-1 100	-1 969,00	
CFD EMSN MES NA 1230	CHF	-124	-4 371,92	
CFD FAST FASTE 1230	USD	-12 313	-40 963,01	
CFD FAURECIA 1230	EUR	7 990	362 985,62	0,03
CFD FDR FONCIE 1230	EUR	-1 291	-4 324,85	
CFD FFIV NETW S 1230	USD	-4 933	-78 236,30	-0,01
CFD GAMESA CFD	EUR	12 454	27 398,80	0,01
CFD GIVN GIVAU 1230	CHF	-48	-9 329,66	
CFD GSK GLAXOS 1230	GBP	-28 044	-31 999,50	
CFD HERMES 1230	EUR	400	6 058,12	
CFD IMPERIAL 1230	GBP	5 681	10 603,73	
CFD ING GROEP 1230	EUR	24 815	34 567,30	
CFD INT.HOT. 1230	GBP	-34 873	11 053,25	
CFD IP INT PAP 1230	USD	-1 390	-5 227,43	
CFD IRM IRON SG 1230	USD	-3 022	-5 708,19	
CFD ITW ILLIN S 1230	USD	-2 858	-47 029,46	
CFD JMT JERONI 1230	EUR	-4 174	-6 261,00	

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD KBX KNORR N 1230	EUR	-1 212	-1 066,56	
CFDKCR KONECR 1230	EUR	4 710	8 881,18	
CFD KNEBV KONE 1230	EUR	-6 777	-24 261,66	
CFD KNIN KUEHN 1230	CHF	-2 074	-31 391,50	
CFD LISN LINDT 1230	CHF	-9	-48 817,97	-0,01
CFD LOW LOWE SG 1230	USD	-5 271	-136 472,84	-0,01
CFD MA MASTER S 1230	USD	-1 770	-3 313,20	
CFD MAR MARRIO 1230	USD	-8 147	-277,27	
CFD MCO MOODY S 1230	USD	-9 838	-198 551,31	-0,02
CFD MITRA PHAR 1230	EUR	26 700	173 550,00	0,02
CFD ML DAIML 1230	EUR	238 344	2 259 677,14	0,23
CFD MMM 3M SG 1230	USD	-4 605	-69 037,78	-0,01
CFD MNST MONST 1230	USD	2 139	-1 085,97	
CFD MTD METTLE 1230	USD	-515	-17 369,69	
CFD NA EQT CORP 1230	USD	2 450	18 240,02	
CFD NA EQUITABL 1230	USD	-129 000	-64 160,38	-0,01
CFD NA FORDMOTO 1230	USD	-78 600	-24 744,32	
CFD NA FORDMOTO 1230	USD	2 500	70 705,35	0,01
CFD NA SPLUNK I 1230	USD	7 500	-398 970,48	-0,04
CFD NAT BRIDGEB 1230	USD	4 000	-163 600,78	-0,02
CFD NATI LVMH M 1230	EUR	-841	-36 247,10	
CFD NATIXIS INT 1230	GBP	15 035	44 479,84	
CFD NAT NN EUR 1230	EUR	3 101	10 822,49	
CFD NAT UMICOR 1230	EUR	18 241	-62 566,63	-0,01
CFD NATX ACS AC 1230	EUR	-10 657	-6 986,73	
CFD NATX ADMIRA 1230	GBP	-1 540	-235,02	
CFD NATX AGEAS 1230	EUR	1 865	9 511,50	
CFD NATX AKAMAI 1230	USD	-49 163	-301 472,64	-0,03
CFD NATX AKZO N 1230	EUR	-5 590	-17 508,49	
CFD NATX ALARM. 1230	USD	-29 500	37 649,96	
CFD NATX ALLIAN 1230	EUR	-19 204	-331 269,00	-0,03
CFD NATX ANGLO 1230	GBP	15 690	-23 511,84	
CFD NATX ASML H 1230	EUR	-2 326	-101 900,45	-0,01
CFD NATX ASR NE 1230	EUR	1 363	4 920,43	
CFD NATX ASSICU 1230	EUR	13 287	20 063,37	0,01
CFD NATX ASTRAZ 1230	GBP	3 746	8 928,94	
CFD NATX ATOS S 1230	EUR	36 694	69 718,60	0,01
CFD NATX AXA 1230	EUR	253 927	529 437,80	0,06
CFD NATX BANCO 1230	EUR	592 899	-296,45	
CFD NATX BARCLA 1230	GBP	146 991	45 416,48	0,01
CFD NATX BAYER 1230	EUR	19 393	74 469,12	
CFD NATX BHP GB 1230	GBP	120 445	-227 509,68	-0,03
CFD NATX BNP PA 1230	EUR	21 829	56 864,55	
CFD NATX BOUYGU 1230	EUR	8 489	-2 314,95	
CFD NATX BP PLC 1230	GBP	56 362	1 918,77	
CFD NATX BRIDGE 1230	USD	-26 800	207 048,41	0,02

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD NATX BRITIS 1230	GBP	6 223	21 075,73	
CFD NATX BURLIN 1230	USD	-44 879	-1 453 314,86	-0,14
CFD NATX BURL S 1230	USD	12 500	1 481 536,63	0,15
CFD NATX CAPGEM 1230	EUR	-17 669	-211 144,55	-0,02
CFD NATX CELLNE 1230	EUR	-14 199	-57 505,95	-0,01
CFD NATX CLARIA 1230	CHF	39 116	1 768,11	
CFD NATX CNP AS 1230	EUR	1 408	1 830,40	
CFD NATX COLOPL 1230	DKK	-5 921	-11 941,91	
CFD NATX CREDIT 1230	EUR	12 182	8 892,86	
CFD NATX DANONE 1230	EUR	10 668	21 762,72	
CFD NATX DATADO 1230	USD	-47 100	483 703,74	0,05
CFD NATX DBX US 1230	USD	-91 200	-283 681,40	-0,03
CFD NATX DEUTSC 1230	EUR	-1 420	-8 733,00	
CFD NATX DSV PA 1230	DKK	2 240	22 990,18	
CFD NATX GEBERI 1230	CHF	-191	-11 292,68	
CFD NATX HEINEK 1230	EUR	-20 255	-95 113,97	-0,01
CFD NATX HELVET 1230	CHF	355	3 626,54	
CFD NATX HERMES 1230	EUR	-730	-15 184,00	
CFD NATX HSBC H 1230	GBP	-140 540	4 949,46	
CFD NATX HUBSPO 1230	USD	-21 152	1 094 044,14	0,11
CFD NATX HUBSPOT INC	USD	7 000	-1 237 998,81	-0,13
CFD NATX IMPERI 1230	GBP	8 118	15 152,46	0,01
CFD NATX ING GR 1230	EUR	100 926	140 589,92	0,01
CFD NATX JUST E 1230	EUR	3 200	-4 032,00	
CFD NATX KERING 1230	EUR	666	-1 143,99	
CFD NATX KERRY 1230	EUR	-2 914	-10 472,88	
CFD NATX KONECR 1230	EUR	-4 710	-5 746,20	
CFD NATX KONINK 1230	EUR	-28 198	-92 492,24	-0,01
CFD NATX L' AIR 1230	EUR	-9 546	-112 161,66	-0,02
CFD NATX LEGAL 1230	GBP	56 103	13 040,31	
CFD NATX LIGAND 1230	USD	-8 900	-32 031,82	
CFD NATX LIGA P 1230	USD	4 000	33 285,12	
CFD NATX LLOYDS 1230	GBP	668 149	27 726,79	0,01
CFD NATX LONZA 1230	CHF	-783	7 617,43	
CFD NATX L OREA 1230	EUR	-18 479	-414 042,23	-0,04
CFD NATX LUME 0 1230	USD	6 000	-212 983,92	-0,02
CFD NATX MEDIOB 1230	EUR	6 407	5 369,07	
CFD NATX MERCK 1230	EUR	-3 258	-36 652,50	
CFD NATX METRO 1230	EUR	-17 795	2 135,40	
CFD NATX MUNICH 1230	EUR	930	18 228,00	
CFD NATX OLD MU 1230	GBP	27 278	-480,33	
CFD NATX OMV AG 1230	EUR	1 241	-394,64	
CFD NATX ORANGE 1230	EUR	-36 968	-857,66	
CFD NATX PALO 1230	USD	-11 300	348 528,04	0,04
CFD NATX PARSON 1230	USD	-86 400	-345 511,78	-0,04
CFD NATX POSTE 1230	EUR	4 932	7 082,35	

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD NATX RECKIT 1230	GBP	-14 501	-23 733,13	-0,01
CFD NATX REMY C 1230	EUR	-2 641	7 084,59	
CFD NATX ROCHE 1230	CHF	-2 281	-15 465,80	
CFD NATX ROYAL 1230	GBP	-11 429	4 159,17	
CFD NATX ROYAL 1230	EUR	-24 579	19 562,43	
CFD NATX SAINSB 1230	GBP	17 676	3 382,27	
CFD NATX SANOFI 1230	EUR	3 895	32 912,75	
CFD NATX SAP SE 1230	EUR	-4 117	-9 716,12	
CFD NATX SIEMEN 1230	EUR	-25 652	-9 491,24	
CFD NATX SIEMEN 1230	EUR	-1 600	-19 232,00	
CFD NATX SOCIET 1230	EUR	29 410	52 349,80	0,01
CFD NATX STOREB 1230	NOK	4 764	5 717,13	
CFD NATX SWISS 1230	CHF	324	3 602,77	
CFD NATX SYMRIS 1230	EUR	-1 741	-11 629,88	
CFD NATX TANDEM 1230	USD	-14 400	94 831,96	
CFD NATX TELEFO 1230	EUR	-47 435	-13 756,15	
CFD NATX TOTAL 1230	EUR	10 792	-4 076,14	
CFD NATX ULTRA 1230	GBP	25 720	35 024,01	
CFD NATX UNILEV 1230	EUR	-16 713	-75 626,33	-0,01
CFD NATX VINCI 1230	EUR	-4 771	-6 297,72	
CFD NATX VIVEND 1230	EUR	-8 230	4 691,10	
CFD NATX VOLKSW 1230	EUR	2 376	155 818,08	0,01
CFD NATX VONNOVI 1230	EUR	1 727	-211,21	
CFD NATX ZYNGA 1230	USD	-506 136	420 656,72	0,04
CFD NATX ZYNGA 1230	USD	5 717	-504 580,18	-0,05
CFD NA WAYFAIR 1230	USD	-31 394	-621 126,61	-0,07
CFD NA WAYFAIR 1230	USD	5 000	920 445,84	0,09
CFD NEM NEWMON 1230	USD	6 860	34 378,80	0,01
CFD NESN NESTL 1230	CHF	-50 947	-433 694,45	-0,05
CFD NOVN NOVAR 1230	CHF	-7 731	-18 031,89	-0,01
CFD NOVOB NOVO 1230	DKK	-30 614	39 949,91	0,01
CFD NTX DATADOG 1230	USD	7 000	-729 898,75	-0,08
CFD NTX FIVE9 I 1230	USD	-46 100	1 133 966,65	0,11
CFD NTX FIVE9 I 1230	USD	8 260	-1 357 667,66	-0,14
CFD NTX SCOUT24 1230	EUR	-1 348	-3 033,00	
CFD NWL NEWELL 1230	USD	-3 349	-10 286,64	
CFD NZYMB NOVO 1230	DKK	-1 487	-5 098,46	
CFD OBL PALO NA 1230	USD	4 000	-410 108,06	-0,04
CFD OSR OSRAM L 1230	EUR	2 031	3 818,28	
CFD PARS CO CFD 1230	USD	6 250	223 666,30	0,03
CFD PAYX PAYCH 1230	USD	-6 423	-37 981,66	-0,01
CFD PNDORA PAN 1230	DKK	7 947	85 483,21	0,01
CFD PSA PUBLIC 1230	USD	-370	-4 035,91	
CFD REMY COIN 1230	EUR	660	90,49	
CFD RHI ROB HL 1230	USD	-9 562	-2 278,02	
CFD RICHEMONT 1230	CHF	-9 411	-26 884,93	

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD RIO TINTO N 1230	GBP	57 457	-412 560,33	-0,04
CFD RI RICARD N 1230	EUR	-11 004	-26 671,91	
CFD ROK ROCKW S 1230	USD	-2 366	-44 610,36	-0,01
CFD ROYAL PHI 1230	EUR	7 050	3 918,39	
CFD RWE 1230	EUR	4 798	4 006,81	
CFD S05 SG ETSY 1230	USD	-2 380	38 143,78	0,01
CFD SC4 SG CARR 1230	EUR	29 633	28 239,99	0,01
CFD SCHP SCHIN 1230	CHF	-2 015	-53 556,03	
CFD SCMN SWISS 1230	CHF	589	15 452,61	
CFDSDD DONG 1230	DKK	1 553	1 988,91	
CFD SED SG ENDE 1230	EUR	7 857	-1 988,61	
CFD SER SG RENO 1230	EUR	25 440	28 701,65	
CFD SGA AENA SG 1230	EUR	-1 993	5 181,80	
CFD SG AAPLE IN 1230	USD	-4 977	-3 768,85	
CFD SG ACCOR 1230	EUR	-7 147	17 152,80	
CFD SG ACUITY B 1230	USD	371	13 163,19	
CFD SG ADOBE IN 1230	USD	-1 176	-19 496,31	
CFD SG ADVANCED 1230	USD	-6 445	-768,82	
CFD SG AEON CO 1230	JPY	-3 357	-2 481,48	
CFD SG AJINOMOT 1230	JPY	-2 248	-2 535,85	
CFD SG AKAMAI 1230	USD	7 000	176 414,53	0,02
CFD SG AKER BP 1230	NOK	4 918	8 578,41	
CFD SG ALBEMARL 1230	USD	3 401	-32 120,39	-0,01
CFD SG ALLEGION 1230	USD	-4 317	-12 252,38	
CFD SG ALLIANT 1230	USD	-1 300	-8 881,99	-0,01
CFD SG ALPHABET 1230	USD	727	25 119,94	
CFD SG AMADEUS 1230	EUR	20 259	44 031,32	0,01
CFD SG AMEREN 1230	USD	-870	-8 209,22	
CFD SG AMERICAN 1230	USD	-826	-6 978,80	
CFD SG AMGEN 1230	USD	-3 509	-71 326,48	
CFD SG ANTOFAGA 1230	GBP	38 921	-42 263,23	
CFD SG ARCELORM 1230	EUR	8 599	45 333,93	
CFD SG ARTISAN 1230	USD	-879	-3 492,67	
CFD SG ATMOS EN 1230	USD	-717	-8 687,21	
CFD SG AUSNET S 1230	AUD	-74 008	-8 632,91	
CFD SG AUTODESK 1230	USD	-1 942	-8 126,73	
CFD SG AZIMUT H 1230	EUR	-7 210	-3 064,25	
CFD SG BALLARD 1230	USD	-1 998	-2 718,45	
CFD SG BANCA GE 1230	EUR	-4 526	-8 146,80	
CFD SG BANK OF 1230	USD	-1 296	-5 656,84	
CFD SG BARRY 1230	CHF	-97	-4 941,82	
CFD SG BEIERSDO 1230	EUR	3 199	3 853,20	
CFD SG BHP GROU 1230	GBP	-24 455	-1 388,38	
CFD SG BLACKROC 1230	USD	-910	-46 038,12	
CFD SG BORG WAR 1230	USD	1 092	1 263,61	
CFD SG BROADRID 1230	USD	-3 604	-21 924,51	

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD SG BROWN-FO 1230	USD	-673	1 494,54	
CFD SG CABOT OI 1230	USD	24 601	5 651,55	
CFD SG CANON 1230	JPY	-11 220	-18 142,67	
CFD SG CAPITA 1230	GBP	-520 662	10 390,62	
CFD SG CARLSBER 1230	DKK	-2 536	12 470,24	
CFD SG CELLNEX 1230	EUR	3 550	15 947,31	
CFD SG CHUGAI P 1230	JPY	2 313	-4 879,95	-0,01
CFD SG CHUGOKU 1230	JPY	-13 832	-9 372,53	
CFD SG CHURCH & 1230	USD	-603	-4 412,32	
CFD SG CME GROU 1230	USD	-413	-1 591,84	
CFD SG CMS ENER 1230	USD	-1 125	-6 805,71	
CFD SG COCALA 1230	USD	-17 817	-56 393,47	
CFD SG COGNIZAN 1230	USD	9 613	37 951,43	
CFD SG CONSOLID 1230	USD	-884	-6 882,16	
CFD SG COPART I 1230	USD	-1 119	-709,69	
CFD SG CORTEVA 1230	USD	-1 850	-2 313,88	
CFD SG COSTCO 1230	USD	-4 041	-48 499,01	-0,01
CFD SG CREE 1230	USD	1 079	-4 893,28	
CFD SG DAI NIP 1230	JPY	-1 757	-5 479,18	-0,01
CFD SG DANAHER 1230	USD	-2 289	-10 536,45	-0,01
CFD SG DANONE 1230	EUR	2 332	-1 163,43	
CFD SG DOMINION 1230	USD	-852	-5 538,40	
CFD SG D R HORT 1230	USD	4 163	39 268,14	0,01
CFD SG DTE ENER 1230	USD	-526	-6 901,15	
CFD SG DUKE ENE 1230	USD	-744	-6 925,35	
CFD SG DUPONT 1230	USD	-1 099	-6 508,16	
CFD SG DWS GRP 1230	EUR	-7 775	-18 115,75	
CFD SG EAST JA 1230	JPY	-2 879	399,03	
CFD SG EDENRED 1230	EUR	4 071	-5 495,85	
CFD SG EDISON I 1230	USD	-1 069	-4 193,05	
CFD SG ELECTRON 1230	USD	-795	-946,99	
CFD SG ELIS 1230	EUR	-9 379	3 939,18	
CFD SG ENERSYS 1230	USD	-2 173	5 292,44	
CFD SG ENTERGY 1230	USD	-625	-6 732,32	-0,01
CFD SGE SAGE NA 1230	GBP	83 504	53 130,45	0,01
CFD SG EUROTU 1230	EUR	-10 657	5 221,93	
CFD SG EVERGY I 1230	USD	-1 271	-6 380,41	
CFD SG EVERSOUR 1230	USD	-772	-4 670,23	
CFD SG EXPEDITO 1230	USD	-6 924	-93 376,50	-0,01
CFD SG FABEGE 1230	SEK	-9 612	-281,48	
CFD SG FACEBOOK 1230	USD	4 686	147 162,65	0,02
CFD SG FASTNED 1230	EUR	3 490	16 346,11	
CFD SG- FE UN 1230	USD	-2 339	-3 084,70	
CFD SG FORTESCU 1230	AUD	34 416	-91 889,00	-0,01
CFD SG FORTIS I 1230	CAD	2 533	9 482,46	
CFD SG FORTUM 1230	EUR	29 942	61 979,94	0,01

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD SG FRANKLIN 1230	USD	-14 656	-42 772,13	-0,01
CFD SG FREEPORT 1230	USD	-3 239	2 700,77	0,01
CFD SG GENERAL 1230	USD	23 994	125 145,26	0,01
CFD SG GOLDMAN 1230	USD	3 844	24 595,32	0,01
CFD SG HANKYU 1230	JPY	-1 597	-122,97	
CFD SG HERSHEY 1230	USD	-3 417	-7 239,57	
CFD SG HESS COR 1230	USD	-1 459	-6 492,44	
CFD SG HEXCEL 1230	USD	-475	289,90	
CFD SG HILTON W 1230	USD	-1 886	4 428,96	
CFD SG HISAMITS 1230	JPY	-2 961	-12 995,78	
CFD SG HONDA 1230	JPY	6 904	21 662,94	
CFD SG HORMEL F 1230	USD	-1 078	-1 293,27	
CFD SG IBM INTL 1230	USD	1 797	21 910,16	
CFD SG INTEL 1230	USD	6 341	17 372,60	
CFD SG INTERCON 1230	USD	-676	-787,99	
CFD SG ITRON IN 1230	USD	638	-15 519,80	
CFD SG JANUS HE 1230	USD	-1 671	-2 729,79	
CFD SG JAPAN P 1230	JPY	-14 143	-8 287,34	
CFD SG JAPAN P 1230	JPY	-3 669	-1 412,56	
CFD SG JAPAN T 1230	JPY	-9 495	-14 622,24	
CFD SG JOHNSON 1230	USD	-492	123,91	
CFD SG JUPITER 1230	GBP	-21 793	4 297,96	
CFD SG KAMIGUMI 1230	JPY	-2 154	-1 741,50	
CFD SG KB HOME 1230	USD	840	4 215,30	
CFD SG KEIHAN 1230	JPY	-1 505	2 085,92	
CFD SG KINDER M 1230	USD	-4 734	-7 854,42	
CFD SG KINTETSU 1230	JPY	-958	1 696,61	
CFD SGK SG HEIA 1230	EUR	4 062	426,51	
CFD SG KYUS RA 1230	JPY	-1 414	2 155,78	
CFD SG LENNAR C 1230	USD	3 354	52 962,84	
CFD SG LIBERTY 1230	USD	-4 808	-5 072,68	
CFD SG LIBERTY 1230	USD	-2 329	-2 050,98	
CFD SG LINDT 1230	CHF	3	-2 807,03	
CFD SG LION COR 1230	JPY	-7 360	-6 403,91	
CFD SG LTD BRAN 1230	USD	-1 737	-10 641,03	-0,01
CFD SG MACY S I 1230	USD	-17 468	-14 565,34	
CFD SG MAN GROU 1230	GBP	-47 848	-6 262,90	
CFD SG MARKETAX 1230	USD	-1 021	25 428,66	
CFD SG MART MG 1230	USD	-11 804	-59 356,45	-0,01
CFD SG MCCORMIC 1230	USD	-589	-2 445,61	
CFD SG MDC 1230	USD	651	4 904,78	
CFD SG MERITAGE 1230	USD	582	3 898,15	
CFD SG METRO WH 1230	EUR	17 795	-35,59	
CFD SG MGM RESO 1230	USD	-2 485	-422,87	
CFD SG MICROSOFT 1230	USD	4 038	11 647,09	
CFD SG MITSUBI 1230	JPY	-2 878	-8 443,15	

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD SG MONOLITH 1230	USD	-1 473	-9 558,77	
CFD SG MOSAIC C 1230	USD	-3 512	-6 603,86	
CFD SG NEC COR 1230	JPY	-832	-4 612,59	-0,01
CFD SG NESTLE 1230	CHF	-22 741	-212 576,90	-0,02
CFD SG NEUROCRI 1230	USD	-38 600	376 580,36	0,04
CFD SG NEW NEWS 1230	USD	-3 889	-6 551,71	
CFD SG NEWS COR 1230	USD	-3 873	-1 779,48	
CFD SG NEXTERA 1230	USD	-906	-1 641,95	
CFD SG NIELSEN 1230	USD	-4 226	-9 852,16	
CFD SG NISOURCE 1230	USD	-2 896	-6 184,77	
CFD SG NISSIN 1230	JPY	-2 166	-2 668,50	
CFD SG NOVO-NOR 1230	DKK	7 653	6 205,54	
CFD SG NVR 1230	USD	43	3 201,97	
CFD SG OBIC CO 1230	JPY	1 079	18 693,60	0,01
CFD SG OCCID PE 1230	USD	-5 179	-44,07	
CFD SG OKTA INC 1230	USD	-28 500	994 699,23	0,10
CFD SG OLD MUTU 1230	GBP	-27 278	480,33	
CFD SG ORACLE 1230	USD	12 487	60 134,79	
CFD SG OSAKA GA 1230	JPY	-2 194	-4 240,33	
CFD SG PFIZER 1230	USD	-769	3,60	
CFD SG PINNACLE 1230	USD	-816	-7 928,80	
CFD SG PIRELLI 1230	EUR	-22 102	-5 017,15	
CFD SG PLUG POW 1230	USD	-1 178	-1 827,79	
CFD SG POOL COR 1230	USD	-1 559	-3 765,18	
CFD SG PPL 1230	USD	-2 338	-5 271,59	
CFD SG PRICE TR 1230	USD	-10 035	-80 771,80	-0,01
CFD SG PROC GAM 1230	USD	-5 168	-52 326,38	-0,01
CFD SG PROP 1230	GBP	-248 900		
CFD SG PROSUS N 1230	EUR	7 816	12 389,14	
CFD SG PUBLICIS 1230	EUR	10 418	36 463,00	
CFD SG PUBLIC S 1230	USD	-1 184	-6 427,23	
CFD SG PULTE GR 1230	USD	3 784	22 234,90	0,01
CFD SG RENAULT 1230	EUR	334 924	-65 310,18	-0,01
CFD SG REPUBLIC 1230	USD	-709	-6 189,35	
CFD SG ROLLINS 1230	USD	-16 120	-20 661,25	
CFD SG S&P GLOB 1230	USD	-7 963	-159 287,10	-0,02
CFD SG SABRE CO 1230	USD	36 438	-6 722,21	
CFD SG SANTOS L 1230	AUD	136 948	-11 537,32	
CFD SG SARTORIU 1230	EUR	496	-99,20	
CFD SG SBM OFFS 1230	EUR	-7 930	-7 414,55	
CFD SG SCHRODER 1230	GBP	-7 772	273,71	
CFD SG SCOTTISH 1230	GBP	13 969	897,14	
CFD SG SECOM 1230	JPY	-1 039	-696,02	
CFD SG SEMPRA E 1230	USD	-523	-7 386,88	
CFD SG SEVEN AN 1230	JPY	-6 032	-19 786,09	
CFD SG SHIMANO 1230	JPY	-311	-6 142,38	

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD SG SOLARIA 1230	EUR	18 615	14 106,45	0,01
CFD SG SOUTHERN 1230	USD	-1 114	-5 156,27	
CFD SG STMIC 1230	EUR	1 000	520,00	
CFD SG SUNTORY 1230	JPY	-1 016	-3 676,89	
CFD SG SYSCO 1230	USD	-2 983	2 258,89	
CFD SG TAISHO 1230	JPY	-2 314	-10 868,81	
CFD SG TELE DEU 1230	EUR	47 435	13 756,15	
CFD SG TELSTRA 1230	AUD	-175 305	-36 353,83	
CFD SG THE AES 1230	USD	-3 250	-691,31	
CFD SG TOBACCO 1230	GBP	15 208	20 076,10	
CFD SG TOBU RA 1230	JPY	-1 069	444,49	
CFD SG TOKYO GA 1230	JPY	-2 348	-4 709,72	
CFD SG TOKYU 1230	JPY	-3 925	-302,22	
CFD SG TOLL BRO 1230	USD	1 683	5 290,57	
CFD SG TORAY I 1230	JPY	-12 363	-1 513,60	
CFD SG TOYO SUI 1230	JPY	-2 863	-2 424,95	
CFD SG TOYOTA M 1230	JPY	15 688	89 752,26	0,01
CFD SG TRI POIN 1230	USD	2 046	2 339,50	
CFD SG UNICREDI 1230	EUR	319 176	150 970,25	0,01
CFD SG UNITED R 1230	USD	1 961	53 275,53	
CFD SG US28176E 1230	USD	-8 789	483,09	
CFD SG US565849 1230	USD	-12 060	4 309,71	0,01
CFD SG WARNER M 1230	USD	-38 072	36 928,51	
CFD SG WASTE CO 1230	USD	-655	-5 734,66	
CFD SG WASTE MA 1230	USD	-934	-14 407,74	
CFD SG WEC ENER 1230	USD	-713	-7 856,16	
CFD SG WEST JA 1230	JPY	-1 461	4 263,62	
CFD SG WHIRLPOO 1230	USD	6 418	165 296,40	0,02
CFD SG WILLIAMS 1230	USD	-3 396	-2 456,05	
CFD SG WOOLWORT 1230	AUD	-42 391	-40 382,85	-0,01
CFD SG WYNN RES 1230	USD	-688	3 723,03	
CFD SG XCEL ENE 1230	USD	-980	-6 603,93	
CFD SG YAKULT H 1230	JPY	-5 443	-13 830,61	
CFD SG ZUMTO 1230	EUR	5 618	10 674,20	
CFD SKFB SVEN N 1230	SEK	-10 596	-1 451,48	
CFD SOG OKTA 0. 1230	USD	10 500	-1 297 290,05	-0,13
CFD ST4 SG TELE 1230	EUR	-2 710	-4 173,40	
CFD STE GALE 1230	EUR	120 714	214 870,92	0,02
CFD SUEZ ENV 1230	EUR	70 934	57 456,54	0,01
CFD TEL2B TELE 1230	SEK	70 264	26 422,54	
CFD TELECOM ITA CFD	EUR	1 111 575	26 058,65	0,01
CFD TMHC TAYLO 1230	USD	5 173	13 633,68	
CFD TXN TEXAS S 1230	USD	-8 655	-123 127,37	-0,01
CFD UB RICHEM 1230	EUR	1 770	2 867,40	
CFD UBS ABB 1230	CHF	7 238	15 965,94	0,01
CFD UPM UPM NA 1230	EUR	-4 013	3 892,61	

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD V62 SG WILL 1230	USD	-332	-2 327,64	
CFD V64 SG AMR 1230	USD	-434	-2 968,91	
CFD V80 SG CENT 1230	USD	-2 910	-7 947,84	-0,01
CFD V82 SG COLG 1230	USD	-1 784	-5 510,01	
CFD V84 SG CROW 1230	USD	-404	-5 630,49	
CFD VEOLIA 1230	EUR	90 498	-42 805,89	
CFD VERBUN 1230	EUR	6 092	-7 310,40	
CFD VNA VONNOVI 1230	EUR	-6 909	-9 185,52	
CFD WENDEL IN 1230	EUR	-663	-7 425,60	
CFD WHITBREAD 1230	GBP	15 627	19 077,04	0,01
CFD WKL WOLTER 1230	EUR	-3 402	-28 712,88	
CFD ZSCALER 0.1 1230	USD	1 800	-276 409,43	-0,03
GVW VESTAS W 1230	DKK	3 721	73 797,10	
H HYATT HOT 1230	USD	-2 768	12 364,50	
IBE SG IBERDR 1230	EUR	3 560	154,86	
KER SG KERING 1230	EUR	-905	-57 648,50	
MC SG LVMH 1230	EUR	-1 255	-54 090,50	
MYU YUM UN 1230	USD	-647	-2 559,81	
NAT TAND DI 1.5 05-2	USD	2 500	-164 043,22	-0,01
NATX LUMENTUM 1230	USD	-41 200	-47 324,09	-0,01
NT INSI EN 0.75 02-2	USD	3 500	375 342,47	0,03
NX ZSCALER INC USD 1	USD	-9 500	269 650,30	0,03
OBL AKAMAI NA 1230	USD	9 000	54 062,79	
PERNOD 1230	EUR	2 751	6 153,71	
SAH SG ASHTEAD 1230	GBP	13 628	71 511,60	0,01
SBC HSBC SG 1230	GBP	81 898	-2 884,24	
SG AIXTRON 1230	EUR	3 029	1 590,23	
SG ALLIANZ 1230	EUR	3 475	12 908,58	
SG ANGLO AMER 1230	GBP	31 767	26 104,24	
SG APA CORPORA 1230	USD	-6 030	9 389,01	
SG ATOS 1230	EUR	-1 649	-1 725,18	
SG AXA 1230	EUR	-17 969	-6 540,72	
SG BANCO NT 1230	EUR	-328 607	164,30	
SG BIA GBP 1230	GBP	138 515	-564,92	
SG CAPITAL CO 1230	GBP	-38 769	-455,12	
SG CARBON 1230	EUR	6 949	-5 837,16	
SG CASINO GUICHARD P	EUR	-3 760	-6 993,60	
SG COLOB 1230	DKK	1 481	-115,82	
SG DUFREY 1230	CHF	-1 353	-2 690,96	
SG ELECTROL 1230	SEK	-52 564	-219 353,39	-0,02
SG ENEL SPA 1230	EUR	106 552	6 661,09	
SG EURO STOXX BK 123	EUR	338 062	3 380 620,00	0,35
SG EXELON 1230	USD	-1 604	-7 069,45	
SG FORD MOT 1230	USD	-14 966	574,30	
SG HARGEAVES 1230	GBP	-3 865	-1 406,53	
SG KERRY GROUP 1230	EUR	729	-760,42	

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SG LIGHT PHIL 1230	EUR	938	7 419,58	
SG L OREA 1230	EUR	2 857	8 772,70	
SG LUNDIN 1230	SEK	4 288	544,15	
SG NOV INC 1230	USD	-5 582	6 554,21	
SG ODAKYU 1230	JPY	-1 384	959,11	
SG PARTNERS 1230	CHF	99	10 426,71	
SG PEPSIC 1230	USD	-5 810	-60 606,31	-0,01
SG RIO 1230	GBP	-3 713	-837,46	
SG ROCHE HO 1230	CHF	-926	-6 278,53	
SG SANOFI 1230	EUR	2 340	19 773,00	
SG SAP SE 1230	EUR	-13 264	-31 303,04	
SG SIEMENS HE	EUR	6 413	-1 594,27	
SG STELLANTIS NV 123	EUR	406 069	672 450,26	0,07
SG STOXX 600 FOOD 12	EUR	-118 177	-4 262 644,39	-0,43
SG TAKEWAY.COM 1230	EUR	-3 200	5 333,14	
SG VERISIGN 30Z	USD	-344	-1 384,43	
SG WISDOMTREE 1230	USD	-38 883	-31 429,29	-0,01
SG YAMAZAKI BAKING C	JPY	-8 628	265,74	
SNO NOVART SG 1230	CHF	8 116	9 759,89	0,01
SPA SG PORSCH 1230	EUR	62 902	1 512 164,08	0,16
SRB RECKIT SG 1230	GBP	3 625	4 998,07	
SSF STANDARD LIFE SG	GBP	-42 068	10 321,31	
SSG SG SWA GR 1230	CHF	-2 362	-1 494,73	
SYG GS STRAUM 1230	CHF	89	6 436,74	
UBS RENEWABLE 1230	NOK	70 427	14 109,62	
VIVENDI SG 1230	EUR	69 283	-39 491,31	
VOLKSWAGEN SG 1230	EUR	85 553	5 610 565,74	0,57
TOTAL CFD			6 636 368,53	0,68
TOTAL Autres instruments financiers à terme			5 726 315,22	0,59
TOTAL Instrument financier à terme			34 408 804,89	3,50
Appel de marge				
APPEL MARGE CACEIS	CHF	725 350	655 742,89	0,07
APPEL MARGE CACEIS	AUD	-146 899,16	-95 197,43	-0,01
APPEL MARGE CACEIS	CAD	-420	-284,32	
APPEL MARGE CACEIS	USD	-31 755 803,49	-27 019 317,19	-2,75
APPEL MARGE CACEIS	SEK	-301 250	-29 406,74	
APPEL MARGE CACEIS	JPY	5 458 405	42 029,55	
APPEL MARGE CACEIS	EUR	-6 132 931,84	-6 132 931,84	-0,62
APPEL MARGE CACEIS	GBP	-1 136 320	-1 333 943,77	-0,14
TOTAL Appel de marge			-33 913 308,85	-3,45
Créances			2 034 311 869,00	206,73
Dettes			-1 893 259 838,41	-192,40
Comptes financiers			92 755 470,49	9,43
Actif net			984 018 159,27	100,00



H2O
Asset Management

H2O AM EUROPE

Société anonyme par actions simplifiée autorisée par l'Autorité des marchés financiers,
sous le numéro GP 19000011
39 avenue Pierre 1^{er} de Serbie - 75008 - Paris - France