



GROUPAMA TRESORERIE ET SES FONDS

NORRICIERS

INVENTAIRE AU

28 FÉVRIER 2023

Actif net 5 387 546 360 €

Inventaire – Poche taux

Obligations secteur privé

Emetteur	Date de maturité	Taux facial de l'émission	Code ISIN	Pourcentage d'actif
CREDIT AGRICOLE LONDON	6 mars 2023		XS1787278008	0,09%
BANK OF AMERICA CORP	26 juil. 2023	0,75%	XS1458405898	0,18%
BANCO BILBAO VIZCAYA ARG - Groupe	9 mars 2023		XS1788584321	0,50%
BMW FINANCE NV	14 avr. 2023	0,00%	XS2102355588	0,28%
BNP PARIBAS - Groupe	22 mai 2023		XS1823532996	0,19%
BPCE SA	23 mars 2023		FR0013323672	0,57%
CREDIT SUISSE AG LONDON	15 sept. 2023	0,00%	XS2152296963	0,81%
CREDIT SUISSE AG LONDON	7 juin 2023	1,00%	XS1428769738	0,87%
CREDIT SUISSE AG LONDON	1 sept. 2023		XS2381633150	0,60%
DEUTSCHE TELEKOM INT FIN	3 avr. 2023	0,62%	XS1382792197	0,47%
FCA BANK SPA IRELAND	10 juin 2023		XS2352609213	0,57%
EIFFAGE SA - Groupe	27 janv. 2025		FR0127838052	0,37%
EIFFAGE SA - Groupe	31 août 2023		FR0127006387	0,83%
GOLDMAN SACHS GROUP INC - Groupe	27 juil. 2023	2,00%	XS1265805090	0,19%
ING GROEP NV	20 sept. 2023	1,00%	XS1882544627	0,11%
INTESA SANPAOLO SPA - Groupe	12 avr. 2023	1,75%	XS1807182495	0,86%
INTESA SANPAOLO SPA - Groupe	30 août 2023	2,12%	XS1873219304	0,22%

Inventaire – Poche taux

Obligations secteur privé

Emetteur	Date de maturité	Taux facial de l'émission	Code ISIN	Pourcentage d'actif
KBC GROEP NV - Groupe	27 juin 2023	0,88%	BE0002602804	0,19%
KBC GROEP NV - Groupe	25 janv. 2024	1,12%	BE0002631126	0,28%
KERING - Groupe	13 mai 2023	0,25%	FR0013512381	0,06%
MERCEDES-BENZ INT FINCE	11 mai 2023	0,75%	DE000A169NB4	0,41%
MERCEDES-BENZ INT FINCE	22 août 2023	1,62%	DE000A289XH6	0,24%
ARCELORMITTAL SA - Groupe	26 avr. 2023	2,70%	FR0127837971	0,26%
ARCELORMITTAL SA - Groupe	30 mars 2023	2,56%	FR0127839092	0,28%
CA CONSUMER FINANCE SA	10 août 2023		FR0127748442	0,56%
CA CONSUMER FINANCE SA	13 oct. 2023		FR0127748715	0,47%
CA CONSUMER FINANCE SA	19 oct. 2023		FR0127749143	0,56%
BARCLAYS BANK PLC	30 nov. 2023		FR0127738682	0,56%
BARCLAYS BANK PLC	3 nov. 2023		FR0127750448	0,74%
BARCLAYS BANK PLC	8 mars 2023		FR0127713339	0,75%
BARCLAYS BANK PLC	18 oct. 2023		FR0127749044	0,47%
BARCLAYS BANK PLC	27 nov. 2023		FR0127752261	0,56%
BFCM	3 juil. 2023		FR0127739359	0,75%
BFCM	5 mai 2023		FR0127740399	0,56%

Inventaire – Poche taux

Obligations secteur privé

Emetteur	Date de maturité	Taux facial de l'émission	Code ISIN	Pourcentage d'actif
BFCM	10 juil. 2023		FR0127742155	0,56%
BFCM	11 sept. 2023		FR0127866798	0,56%
BFCM	17 juil. 2023		FR0127744292	0,93%
SAVENCIA SA	27 mars 2023	2,50%	FR0127838375	0,28%
SAVENCIA SA	6 mars 2023	2,55%	FR0127740555	0,37%
SAVENCIA SA	8 mars 2023	2,60%	FR0127866475	0,37%
BPCE SA	4 août 2023		FR0127771675	0,47%
BPCE SA	11 sept. 2023		FR0127866871	0,56%
BPCE SA	9 mai 2023		FR0127713461	0,93%
BPCE SA	13 mars 2023		FR0127642744	0,56%
BPCE SA	14 nov. 2023		FR0127868331	0,56%
BPCE SA	14 mars 2023		FR0127586321	0,94%
BPCE SA	18 oct. 2023		FR0127811497	0,56%
CRCA BRIE PICARDIE	9 nov. 2023		FR0127801258	0,56%
CM ARKEA	9 mars 2023		FR0127583971	0,56%
CM ARKEA	13 mars 2023		FR0127586438	0,56%
CREDIT INDUSTRIEL ET COMMERCIA	25 août 2023		FR0127837252	0,56%

Inventaire – Poche taux

Obligations secteur privé

Emetteur	Date de maturité	Taux facial de l'émission	Code ISIN	Pourcentage d'actif
CREDIT AGRICOLE SA	1 mars 2023	2,40%	FR0127888511	1,67%
CRCA AQUITAINE	26 avr. 2023		FR0127644518	0,19%
CRCA ALPES PROVENCE	26 avr. 2023		FR0127644484	0,19%
CRCAM CHARENTE PERIGORD	25 oct. 2023		FR0127801126	0,37%
CRCA TOULOUSE 31	14 nov. 2023		FR0127801340	0,37%
CRCA NORD EST	14 nov. 2023		FR0127801332	0,24%
CRCA NORD EST	26 avr. 2023		FR0127644476	0,28%
CRCA ANJOU ET MAINE	30 oct. 2023		FR0127801068	0,47%
CRCA COTES D'ARMOR	25 juil. 2023		FR0127801167	0,37%
ELECTRICITE DE FRANCE SA	15 juin 2023	2,84%	FR0127694869	0,55%
ELECTRICITE DE FRANCE SA	8 mars 2023	2,50%	FR0127694695	0,56%
ELECTRICITE DE FRANCE SA	13 mars 2023	2,50%	FR0127694786	0,93%
ELIS SA	6 mars 2023	2,55%	FR0127740308	0,24%
ENDESA SA	14 avr. 2023	2,64%	ES05306743X8	0,37%
ENDESA SA	3 avr. 2023	2,55%	ES05306743J7	0,56%
ENDESA SA	7 juil. 2023	3,17%	ES05306744D8	0,55%
ENDESA SA	10 mars 2023	2,57%	ES05306743L3	0,74%



Inventaire – Poche taux

Obligations secteur privé

Emetteur	Date de maturité	Taux facial de l'émission	Code ISIN	Pourcentage d'actif
ENEL FINANCE INTL NV	20 mars 2023	2,42%	XS2569685766	0,37%
ENEL FINANCE INTL NV	29 mars 2023	2,46%	XS2580627441	0,56%
ENEL FINANCE INTL NV	30 mars 2023	2,58%	XS2582764853	1,39%
ENEL FINANCE INTL NV	28 juil. 2023	3,28%	XS2582865619	0,91%
ENEL FINANCE INTL NV	29 mars 2023	2,54%	XS2587139077	0,37%
ENEL FINANCE INTL NV	29 mars 2023	2,70%	XS2589691380	0,46%
ENGIE SA	2 mars 2023		FR0127793091	0,93%
ENGIE SA	3 mars 2023		FR0127844712	1,30%
ENGIE SA	6 mars 2023		FR0127850941	0,93%
ENGIE SA	8 mars 2023		FR0127793216	0,56%
ENGIE SA	13 mars 2023		FR0127845214	1,21%
FAURECIA - Groupe	5 avr. 2023		FR0127740381	0,37%
FAURECIA - Groupe	11 avr. 2023		FR0127714188	0,19%
FAURECIA - Groupe	23 mai 2023		FR0127816249	0,47%
FAURECIA - Groupe	25 mai 2023		FR0127837526	0,19%
FAURECIA - Groupe	27 avr. 2023		FR0127747378	0,14%
FCA BANK SPA - Groupe	10 juil. 2023	3,05%	XS2575155168	0,37%



Inventaire – Poche taux

Obligations secteur privé

Emetteur	Date de maturité	Taux facial de l'émission	Code ISIN	Pourcentage d'actif
FCA BANK SPA IRELAND	15 mars 2023	2,35%	XS2569078103	0,37%
FCA BANK SPA IRELAND	24 juil. 2023	3,17%	XS2580717515	0,23%
FCA BANK SPA IRELAND	2 mai 2023	2,83%	XS2583739953	0,46%
FERROVIAL SA	16 mars 2023	2,49%	XS2577364669	0,37%
FERROVIAL SA	9 mars 2023	2,48%	XS2587542809	0,28%
ILIAD SA	6 avr. 2023	2,83%	FR0127792572	0,35%
IMPERIAL BRANDS FIN PLC	13 mars 2023	2,59%	XS2588946777	0,61%
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND P	17 avr. 2023	2,57%	XS2578377777	0,55%
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND P	27 avr. 2023	2,67%	XS2582394230	0,55%
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND P	2 mai 2023	2,75%	XS2584093533	0,55%
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND P	10 août 2023	3,24%	XS2587540696	0,55%
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND P	14 août 2023	3,27%	XS2589260640	0,55%
LAGARDERE SCA	28 avr. 2023	3,25%	FR0127749846	0,41%
LAGARDERE SCA	6 avr. 2023	3,24%	FR0127748376	0,06%
LAGARDERE SCA	11 avr. 2023	3,23%	FR0127748582	0,15%
LAGARDERE SCA	14 avr. 2023	3,36%	FR0127751446	0,04%
LAGARDERE SCA	20 mars 2023	3,08%	FR0127749283	0,09%

Inventaire – Poche taux

Obligations secteur privé

Emetteur	Date de maturité	Taux facial de l'émission	Code ISIN	Pourcentage d'actif
CREDIT LYONNAIS SACA	4 août 2023		FR0127771808	0,47%
CREDIT LYONNAIS SACA	7 sept. 2023		FR0127865741	0,37%
CREDIT LYONNAIS SACA	15 nov. 2023		FR0127868935	0,56%
CREDIT LYONNAIS SACA	18 oct. 2023		FR0127811547	0,56%
CREDIT LYONNAIS SACA	20 oct. 2023		FR0127815605	0,56%
LES MOUSQUETAIRES SAS	9 mai 2023	2,96%	FR0127770636	0,74%
LES MOUSQUETAIRES SAS	6 mars 2023	2,51%	FR0127734194	0,28%
LES MOUSQUETAIRES SAS	17 avr. 2023	2,74%	FR0127769703	0,18%
LES MOUSQUETAIRES SAS	20 avr. 2023	2,81%	FR0127362384	0,09%
NATWEST MARKETS PLC	9 mai 2023		XS2556255276	0,56%
BANQUE PALATINE SA	1 juin 2023		FR0127739268	0,47%
BANQUE PALATINE SA	8 mars 2023		FR0127713354	0,47%
BANQUE PALATINE SA	9 mai 2023		FR0127742510	0,56%
CIE PLASTIC-OMNIUM SA	7 mars 2023	2,42%	FR0127638668	0,28%
CIE PLASTIC-OMNIUM SA	26 avr. 2023	2,80%	FR0127688614	0,37%
CIE PLASTIC-OMNIUM SA	28 avr. 2023	2,91%	FR0127696351	0,09%
CIE PLASTIC-OMNIUM SA	12 mai 2023	2,99%	FR0127845073	0,18%

Inventaire – Poche taux

Obligations secteur privé

Emetteur	Date de maturité	Taux facial de l'émission	Code ISIN	Pourcentage d'actif
PSA BANQUE FRANCE - Groupe	8 juin 2023		FR0127742403	0,56%
PSA BANQUE FRANCE - Groupe	15 juin 2023		FR0127744755	0,47%
RCI BANQUE SA	14 avr. 2023		FR0127529594	0,28%
RCI BANQUE SA	17 avr. 2023	2,51%	FR0127684829	0,28%
RENAULT SA - Groupe	6 mars 2023	2,52%	FR0127734103	0,11%
RENAULT SA - Groupe	9 mars 2023	2,52%	FR0127734475	0,56%
RENAULT SA - Groupe	20 mars 2023	2,54%	FR0127734962	0,26%
RENAULT SA - Groupe	7 août 2023	3,35%	FR0127770677	0,60%
REPSOL EUROPE FINANCE	9 mars 2023	2,47%	XS2587532081	0,28%
SSE PLC - Groupe	26 avr. 2023	2,70%	XS2581845059	0,55%
SSE PLC - Groupe	27 avr. 2023	2,71%	XS2582063397	0,46%
SOCIETE GENERALE - Groupe	7 sept. 2023		FR0127750802	0,56%
SOCIETE GENERALE - Groupe	21 août 2023		FR0127749317	0,56%
SOCIETE GENERALE - Groupe	30 juin 2023		FR0127749309	0,56%
SOCIETE GENERALE - Groupe	27 juil. 2023		FR0127749788	0,56%
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	24 avr. 2023	2,60%	FR0127836593	0,37%
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	28 avr. 2023	2,67%	FR0127838813	0,37%

Inventaire – Poche taux

Obligations secteur privé

Emetteur	Date de maturité	Taux facial de l'émission	Code ISIN	Pourcentage d'actif
UNIVERSAL MUSIC GROUP NV	10 mars 2023	2,56%	FR0127867580	0,11%
VALEO SA	21 avr. 2023	2,64%	FR0127735068	0,28%
VALEO SA	24 avr. 2023	2,65%	FR0127735076	0,28%
VALEO SA	2 mai 2023	2,78%	FR0127769224	0,28%
VALEO SA	27 juil. 2023	3,11%	FR0127770271	0,27%
VALEO SA	5 juin 2023	3,05%	FR0127735548	0,55%
VATTENFALL AB	30 mars 2023	2,42%	XS2562948773	0,56%
VICAT SA - Groupe	9 mars 2023	2,50%	FR0127742619	0,09%
VICAT SA - Groupe	20 mars 2023	2,60%	FR0127745224	0,17%
VICAT SA - Groupe	13 mars 2023	2,55%	FR0127800185	0,03%
VICAT SA - Groupe	16 mars 2023	2,56%	FR0127748772	0,09%
VICAT SA - Groupe	9 mai 2023	3,02%	FR0127851063	0,39%
VOLKSWAGEN FIN SERV AG	11 juil. 2023	3,02%	XS2577039089	0,55%
VOLKSWAGEN LEASING GMBH	31 juil. 2023	3,12%	XS2583179473	0,64%
VOLKSWAGEN LEASING GMBH	2 août 2023	3,15%	XS2584080985	0,55%
VOLKSWAGEN LEASING GMBH	28 avr. 2023	2,67%	XS2583191411	0,37%
NATWEST MARKETS PLC	14 juin 2023	1,12%	XS1837997979	0,09%

Inventaire – Poche taux

Obligations secteur privé

Emetteur	Date de maturité	Taux facial de l'émission	Code ISIN	Pourcentage d'actif
NATWEST MARKETS PLC	26 mai 2023		XS2346730174	0,65%
COOPERATIEVE RABOBANK UA - Groupe	29 août 2023	0,75%	XS1871439342	0,06%
RCI BANQUE SA	8 mars 2023	0,25%	FR0013448669	0,84%
SANTAN CONSUMER FINANCE	30 mai 2023	0,88%	XS1824235219	0,28%
BANCO SANTANDER SA - Groupe	16 janv. 2025		XS2575952341	0,28%
BANCO SANTANDER SA - Groupe	28 mars 2023		XS1689234570	0,24%
VOLVO TREASURY AB	27 sept. 2023		XS2390692742	0,52%
VOLKSWAGEN BANK GMBH	15 juin 2023	0,75%	XS1734548487	0,06%
VOLKSWAGEN FIN SERV AG	6 avr. 2023		XS2328430470	0,08%
WORLDLINE SA/FRANCE - Groupe	30 juin 2023	0,50%	FR0013521549	0,09%

Inventaire – OPC

Actif	Code ISIN	Pourcentage d'actif
GROUPAMA ENTREPRISES - IC	FR0010213355	4,31%
GROUPAMA MONETAIRE - IC	FR0010582452	4,31%

Inventaire – Dérivés obligations

Actif	Pourcentage d'actif
IRS PAY EUR -0.272%/REC EURIBOR3M 26/01/2024	0,01%
IRS PAY EUR -0.348%/REC EURIBOR3M 31/07/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/-0.454% 03/03/2023	0,01%
IRS REC EUR OIS/-0.487% 07/03/2023	0,01%
IRS REC EUR OIS/1.1867% 15/09/2023	0,01%
IRS REC EUR OIS/1.9747% 06/03/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/1.9812% 06/03/2023	-0,00%
IRS REC EUR OIS/1.9862% 07/03/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.0072% 09/03/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.0632% 15/03/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.1022% 17/03/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.1092% 20/03/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.1097% 20/03/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.1797% 13/03/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.2002% 16/03/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.2737% 14/03/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.2737% 23/03/2023	0,00%



Inventaire – Dérivés obligations

Actif	Pourcentage d'actif
IRS REC EUR OIS/2.2802% 21/04/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.2812% 06/04/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.2972% 24/04/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.3737% 06/03/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.3862% 30/03/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.3997% 17/04/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.4057% 17/04/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.4367% 03/04/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.4752% 24/04/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.4862% 29/03/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.5022% 26/04/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.5027% 26/04/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.5032% 26/04/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.5077% 06/04/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.5132% 27/04/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.5147% 27/04/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.5357% 28/04/2023	0,00%



Inventaire – Dérivés obligations

Actif	Pourcentage d'actif
IRS REC EUR OIS/2.5382% 28/04/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.5462% 28/04/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.5652% 11/04/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.5742% 02/05/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.5857% 02/05/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.6417% 09/05/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.6452% 09/05/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.6682% 09/05/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.6862% 12/05/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.7067% 10/07/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.7287% 11/07/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.7387% 03/06/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.7982% 24/07/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.8297% 27/07/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.8642% 28/07/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.8687% 07/07/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.8772% 31/07/2023	0,00%



Inventaire – Dérivés obligations

Actif	Pourcentage d'actif
IRS REC EUR OIS/2.9172% 02/08/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/2.9592% 07/08/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/3.0052% 10/08/2023	0,00%
IRS REC EUR OIS/3.0462% 14/08/2023	0,00%

Inventaire – Trésorerie

Actif

Pourcentage d'actif

Trésorerie

18,02%

AVERTISSEMENT

- › Ce document est conçu exclusivement à des fins d'information.
- › Groupama Asset Management et ses filiales déclinent toute responsabilité en cas d'altération, déformation ou falsification dont ce document pourrait faire l'objet.
- › Les informations contenues dans ce document sont confidentielles et réservées à l'usage exclusif de ses destinataires.
- › Toute modification, utilisation ou diffusion non autorisée, en tout ou partie de quelque manière que ce soit est interdite.
- › Les performances passées ne sont pas un indicateur fiable des performances futures.
- › Tout investisseur doit prendre connaissance avant tout investissement du prospectus ou du document d'information clé de l'investisseur (DICI) de l'OPC. Ces documents et les autres documents périodiques peuvent être obtenus gratuitement sur simple demande auprès de Groupama AM ou sur www.groupama-am.com
- › Les informations contenues dans cette publication sont basées sur des sources que nous considérons fiables, mais nous ne garantissons pas qu'elles soient exactes, complètes, valides ou à propos.
- › Ce document a été établi sur la base d'informations, projections, estimations, anticipations et hypothèses qui comportent une part de jugement subjectif. Les analyses et conclusions sont l'expression d'une opinion indépendante, formée à partir des informations publiques disponibles à une date donnée et suivant l'application d'une méthodologie propre à Groupama AM. Compte tenu du caractère subjectif et indicatif de ces analyses, elles ne sauraient constituer un quelconque engagement ou garantie de Groupama AM ou un conseil en investissement personnalisé.
- › Ce support non contractuel ne constitue en aucun cas une recommandation, une sollicitation d'offre, ou une offre d'achat, de vente ou d'arbitrage, et ne doit en aucun cas être interprété comme tel.
- › Les équipes commerciales de Groupama Asset Management et ses filiales sont à votre disposition afin de vous permettre d'obtenir une recommandation personnalisée.
- › Edité par Groupama Asset Management - Siège social : 25, rue de la Ville l'Evêque, 75008 Paris - Site web : www.groupama-am.com



Groupama
ASSET MANAGEMENT

Siège social : 25, rue de la Ville l'Evêque
75008 Paris

Tél.: 01.44.56.76.76

Société de gestion de portefeuille

Agrément GP93-02 du 05/01/93

Société Anonyme au capital de 1 878 910 euros

389 522 152 RCS Paris

Siret 389 522 152 00 047 – APE 6630Z

www.groupama-am.com