



H2O
Asset Management

OPCVM de droit français

H2O MULTISTRATEGIES

PUBLICATION SEMESTRIELLE

au 30 septembre 2019

Société de Gestion : H2O AM LLP

Dépositaire : Caceis Bank

Commissaire aux comptes : Kpmg Audit

H2O AM LLP 10 Old Burlington Street – London W1S 3AG, Grande Bretagne - Tél. : +44 (0) 20 7292 1616
Limited Liability Partnership de droit anglais , agréée par la Financial Services Authority, l'Autorité des marchés financiers du Royaume-Uni sous le numéro 529105

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.	1 133 832 212,09
b) Avoirs bancaires	25 667 815,26
c) Autres actifs détenus par l'OPC	5 788 836 901,07
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	6 948 336 928,42
e) Passif	-5 825 708 711,37
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	1 122 628 217,05

* 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 N en EUR	C	29 326 744,92	245 383,7100	119,51
H2O MULTISTRATEGIES HSGD-R en SGD	C	550 545,67	2 696,6389	204,15
H2O MULTISTRATEGIES HCHF-R en CHF	C	3 652 544,83	14 006,6152	260,77
H2O MULTISTRATEGIES R en EUR	C	973 527 419,02	2 663 712,1956	365,47
H2O MULTISTRATEGIES I en EUR	C	111 937 632,21	294,5278	380 057,95
H2O MULTISTRATEGIES RUSD en USD	C	2 852 268,36	14 150,6403	201,56
H2O MULTISTRATEGIES HCHF-I en CHF	C	897 793,41	5,1463	174 454,15
H2O MULTISTRATEGIES IUSD en USD	C	729 577,36	4,0196	181 504,96

• **ELEMENTS 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.	40,66	6,57
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.	53,85	8,70
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.	10,47	1,69

* 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 **
Dollar canadien	CAD	430 984,93	0,04	0,01
Dollar us	USD	201 042 231,42	17,91	2,89
Euro	EUR	437 175 965,07	38,94	6,29
Livre sterling	GBP	42 356 784,60	3,77	0,61
Peso mexicain	MXN	389 653 133,89	34,71	5,61
Yen	JPY	15 840 412,18	1,41	0,23
TOTAL		1 086 499 512,09	96,78	15,64

* 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	34,71	5,61
Grece	12,28	1,98
France	11,90	1,92
Etats unis amerique	11,55	1,87
Italie	6,61	1,07
Turquie	5,10	0,82
Pays-bas	4,46	0,72
Royaume uni	3,77	0,61
Allemagne	2,82	0,45
Japon	1,41	0,23
Portugal	1,01	0,16
Bermudes	0,56	0,09
Iles caimans	0,34	0,06
Irlande	0,08	0,01
Suisse	0,08	0,01
Canada	0,04	0,01
Afrique du sud	0,03	0,01
Israel	0,03	
TOTAL	96,78	15,64

* 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	3,55	0,57
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE		
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés		
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés		
Autres organismes non européens	0,42	0,07
Autres Actifs		
Autres	7,24	1,17
TOTAL	11,22	1,81

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

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

- **MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE EN EUR**

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.	525 808 686,01	552 058 991,21
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.	167 954 049,92	322 922 853,93
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.		2 106 570,00

- **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 LLP - 10 Old Burlington Street - London W1S 3AG - Grande Bretagne

• TRANSPARENCE DES OPERATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA REUTILISATION DES INSTRUMENTS FINANCIERS – REGLEMENT SFTR – en devise de comptabilité de l'OPC (EUR)

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS – Total Return Swap
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-------------------------

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			133 205 328,65		326 190 806,73
% de l'actif net			11,87%		47,76%

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

BNP PARIBAS FRANCE FRANCE			88 524 585,03		
JP MORGAN SECURITIES LONDRES ROYAUME UNI			44 680 743,62		
BNP PARIBAS FRANCE FRANCE					210 728 171,80
B.R.E.D. PARIS FRANCE					20 121 221,26
MERRILL LYNCH INTERNATIONAL ROYAUME UNI					11 568 700,00
MERRILL LYNCH INTERNATIONAL BANK LTD Autres Pays					10 218 008,00
NATIXIS FRANCE					5 182 500,00
UBS AG SINGAPORE BRANCH Autres Pays					4 937 114,65
SOCIETE GENERALE CORPORATE INVESTMENT BANKING Autres Pays					1 277 658,00
SOCIETE GENERALE FRANCE					1 224 000,00
UBS AG LONDON BRANCH ROYAUME UNI					388 117,52

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS – Total Return Swap
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-------------------------

e) Type et qualité des garanties (collatéral)

Type					
- Actions					
- Obligations					
- OPC					
- TCN					
- Cash			478 027 424,28		37 436 791,60
Rating					

Monnaie de la garantie					
- EURO			87 449 712,75		37 436 791,60
- PESO MEXICAIN			390 577 711,53		

f) Règlement et compensation des contrats

Triparties					
Contrepartie centrale					
Bilatéraux	X			X	

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			9 329 738,54		
1 semaine à 1 mois			88 524 585,03		140 000,00
1 à 3 mois			35 351 005,08		88 374 564,17
3 mois à 1 an					52 545 600,76
Plus d'1 an					185 130 641,80
Ouvertes					

i) Données sur la réutilisation des garanties

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

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS – Total Return Swap
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-------------------------

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

Caceis Bank					
Titres					
Cash					37 436 791,60

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

Titres					
Cash					

l) Données sur les revenus et les coûts ventilés

Revenus					
- OPC			69 450,28		
- Gestionnaire					
- Tiers					
Coûts					
- OPC			14 836 017,07		
- Gestionnaire					
- Tiers					

e) 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, en mode agent ou en mode principal, 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 peuvent être conclues avec H2O. Dans certains cas, ces mêmes opérations peuvent être conclues avec des contreparties de marché et intermédiées par H2O.

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 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				
AFRIQUE DU SUD				
NASPERS -N- SPONSORED AMERICAN DEPOSIT RECEIPT REPR 1/5 SH -	USD	13 630	374 568,70	0,03
TOTAL AFRIQUE DU SUD			374 568,70	0,03
ALLEMAGNE				
AMATHEON AGRI	EUR	200 000	18 500,00	
TOTAL ALLEMAGNE			18 500,00	
BERMUDES				
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	USD	5 537	153 128,37	0,01
BUNGE LTD	USD	46 100	2 394 223,08	0,21
LAZARD A	USD	117 894	3 784 892,68	0,34
TOTAL BERMUDES			6 332 244,13	0,56
CANADA				
AGF MANAGEMENT PREF.CL.B	CAD	73 416	315 341,16	0,03
BALLARD POWER SYSTEMS	CAD	25 800	115 643,77	0,01
TOTAL CANADA			430 984,93	0,04
ETATS UNIS AMERIQUE				
ABERCROMBIE & FITCH CO	USD	8 455	120 985,14	0,01
ACUITY BRANDS INC	USD	1 300	160 729,22	0,01
AKAMAI TECHNOLOGIES	USD	13 100	1 098 035,22	0,10
AKORN	USD	30 933	107 820,03	0,01
AMERICAN AIRLINES GROUP INC - REGS	USD	13 800	341 392,41	0,03
AMGEN	USD	26 623	4 725 570,29	0,42
APPLE INC / EX - APPLE SHS	USD	31 859	6 545 092,85	0,57
BANK OF NEW YORK MELLON	USD	4 130	171 268,85	0,02
BIOGEN IDEC INC	USD	10 941	2 336 528,73	0,21
BORGWARNER INC	USD	2 200	74 019,45	0,01
CELGENE	USD	18 791	1 711 563,29	0,15
CIENA	USD	79 700	2 867 942,58	0,26
COTY INC-CL A	USD	84 011	809 902,41	0,07
CREE	USD	4 500	202 256,47	0,02
CYPRESS SEMICONDUCTOR	USD	21 370	457 508,53	0,04
DELTA AIR LINES	USD	12 300	649 862,41	0,06
DR HORTON INC	USD	122 376	5 916 748,27	0,53
EMERSON ELECTRIC	USD	79 571	4 879 945,94	0,43
ENERSYS INC	USD	1 600	96 774,90	0,01
EVERCORE INC	USD	47 016	3 454 395,16	0,31
FACEBOOK INC-A	USD	19 324	3 156 501,49	0,28

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
FORD MOTOR COMPANY	USD	434 909	3 654 161,11	0,33
FuelCell Energy --- Registered Shs	USD	351	105,41	
GENERAL ELECTRIC CO USD	USD	103 090	845 372,04	0,08
GENERAL MOTORS CO	USD	143 860	4 945 764,81	0,44
GENESEE WYOMING IN	USD	3 739	379 010,17	0,03
GILEAD SCIENCES INC	USD	13 021	756 990,44	0,07
GOLDMAN SACHS GROUP	USD	25 773	4 899 044,94	0,44
HERT RENT CAR HOLD COMP INC	USD	28 013	355 622,75	0,03
HEXCEL CORP	USD	9 800	738 281,05	0,07
HOULIHAN LOKEY INC	USD	96 725	4 001 373,60	0,36
ILLUMINA	USD	2 436	679 765,11	0,06
ITRON INC.	USD	3 000	203 522,29	0,02
KB HOME	USD	24 977	778 956,15	0,07
LENNAR CORP COM	USD	94 760	4 854 472,57	0,43
LIVONGO HEALTH INC	USD	12 291	196 619,92	0,02
M D C HOLDINGS	USD	18 934	748 537,33	0,07
MACYS INC.	USD	21 082	300 508,42	0,03
MERITAGE HOMES	USD	11 943	770 675,15	0,07
MONSTER BEVERAGE CORP	USD	16 500	878 728,67	0,08
MORGAN STANLEY	USD	19 200	751 480,46	0,07
NETWORK APPLIANCE INC	USD	52 300	2 519 054,30	0,22
NIKE INC CLASS B COM NPV	USD	44 787	3 858 370,06	0,34
NVR	USD	968	3 300 674,00	0,29
ORACLE CORP COM	USD	189 198	9 550 143,04	0,84
PLUG POWER INC	USD	32 700	78 885,53	0,01
PULTE GROUP	USD	81 733	2 740 177,17	0,24
REGENERON PHARMACEUTICALS	USD	14 015	3 566 098,88	0,32
SALESFORCE.COM INC	USD	16 400	2 232 999,45	0,20
SHOCKWAVE MEDICAL INC	USD	32 736	898 723,61	0,08
SPRINT CORP-W/I	USD	278 277	1 574 912,03	0,14
SYMANTEC CORP	USD	133 328	2 889 874,00	0,26
TAYLOR MORRISON HOME CORP	USD	40 207	956 677,29	0,09
TESLA INC	USD	351	77 550,33	0,01
TMOBILE US INC	USD	99 972	7 223 256,69	0,63
TOLL BROTHERS INC	USD	43 827	1 650 246,15	0,15
TRI POINTE GROUP SHS	USD	52 011	717 524,71	0,06
TWITTER INC	USD	133 300	5 037 571,09	0,45
UNITED CONTINENTAL HOLDINGS	USD	8 500	689 309,30	0,06
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	USD	9 774	1 518 905,78	0,14

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
VOYA FINANCIAL INC	USD	67 274	3 359 380,44	0,30
WABTEC	USD	334	22 015,45	
WENDY'S COMPANY (THE)	USD	130 700	2 395 327,46	0,21
WHIRLPOOL CORP	USD	13 000	1 888 350,76	0,17
ZAYO GROUP HOLDINGS INC	USD	9 665	300 535,22	0,03
TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE			129 670 398,77	11,56
IRLANDE				
HORIZON PHARMA PLC	USD	36 727	917 332,79	0,08
TOTAL IRLANDE			917 332,79	0,08
ISRAEL				
MELLANOX TECHNOLOGIES LTD	USD	3 429	344 692,82	0,03
TOTAL ISRAEL			344 692,82	0,03
JAPON				
GCA SAVVIAN GROUP CORPORATION	JPY	116 200	764 322,18	0,07
HITACHI CHEMI	JPY	93 200	2 788 326,76	0,25
HONDA MOTOR CO JPY50	JPY	75 850	1 801 563,31	0,16
NGK INSULATORS JPY50	JPY	135 800	1 773 809,69	0,16
NISSAN MOTOR CO	JPY	163 126	933 289,00	0,08
STRIKE COMPANY LTD	JPY	47 800	1 180 158,26	0,11
TOYOTA MOTOR	JPY	107 748	6 598 942,98	0,59
TOTAL JAPON			15 840 412,18	1,42
MEXIQUE				
URBI DESARROLLOS URBANOS	MXN	488 028	34 009,00	
TOTAL MEXIQUE			34 009,00	
PAYS-BAS				
Altice Europe N.V.	EUR	47 900	229 920,00	0,02
LA PERLA FASHION HOLDING NV	EUR	4 000 000	8 000 000,00	0,71
LYONDELLBASELL INDUSTRIES A	USD	5 472	449 073,42	0,04
PHILIPS LIGHTING NEWCO BV	EUR	22 900	577 767,00	0,05
PROSUS ADR	EUR	13 630	180 025,04	0,02
TOTAL PAYS-BAS			9 436 785,46	0,84
SUISSE				
GARRETT MOTION INC-WI	USD	94 719	865 346,95	0,08
TOTAL SUISSE			865 346,95	0,08
TOTAL Actions & val. ass. ng. sur marchés régl. ou ass.			164 265 275,73	14,64

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Actions et valeurs assimilées non négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
PAYS-BAS				
AVATERA MEDICAL INVESTMENT	EUR	15 070 000	39 332 700,00	3,50
TOTAL PAYS-BAS			39 332 700,00	3,50
TOTAL Actions & val. ass. non ng. sur mar. régl. ou ass.			39 332 700,00	3,50
TOTAL Actions et valeurs assimilées			203 597 975,73	18,14
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
ALLEMAGNE 0.25% 11-10-19	EUR	31 500 000	31 584 368,22	2,81
TOTAL ALLEMAGNE			31 584 368,22	2,81
FRANCE				
AXASA 5 1/2 07/22/49	USD	500 000	473 013,87	0,04
SOCGEN TV 11/49	USD	1 000 000	571 655,13	0,05
TOTAL FRANCE			1 044 669,00	0,09
GRECE				
GRECE 15/10/2042	EUR	19 821 900	80 080,48	0,01
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 3.5% 30-01-23	EUR	55 963 236	62 905 931,56	5,61
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 3.75% 29-01-28	EUR	39 926 352	48 703 810,45	4,34
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 3.9% 30-01-33	EUR	17 278 593	22 057 213,94	1,96
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 4.2% 29-01-42	EUR	2 969 725	4 066 286,40	0,36
TOTAL GRECE			137 813 322,83	12,28
ILES CAIMANS				
ADS SECURITIES FUNDING LIMITED 6.5% 18-06-23	USD	15 550 000	3 833 695,14	0,34
TOTAL ILES CAIMANS			3 833 695,14	0,34
ITALIE				
BTPS 4 3/4 09/01/44	EUR	15 200 000	24 290 821,01	2,16
ITALIE 5%09-010325	EUR	3 000 000	3 768 924,73	0,34
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.0% 01-08-29	EUR	4 457 000	5 400 900,55	0,48
TOTAL ITALIE			33 460 646,29	2,98
MEXIQUE				
CORPORACION GEO SA DE CV 9.25% 30-06-20 DEFAULT	USD	4 280 000	157,04	
CORPORACION GEO 8.875% 03/22 DEFAULT	USD	4 000 000	146,76	
MEXICAN BONOS 10.0% 05-12-24	MXN	22 019 300	120 184 695,53	10,70
MEXICAN BONOS 7.5% 03-06-27 - PAYE TOUS LES 182 JOURS	MXN	23 580 000	116 361 134,40	10,37
MEXICAN BONOS 7.75% 23-11-34	MXN	3 043 800	15 318 244,84	1,36
MEXICAN BONOS 7.75% 29-05-31	MXN	7 869 000	39 615 993,19	3,53
MEXICAN BONOS 8.0% 07-12-23	MXN	5 400 000	26 904 160,06	2,40

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
MEXICAN BONOS 8.5% 31-05-29	MXN	13 435 000	71 234 896,87	6,35
TOTAL MEXIQUE			389 619 428,69	34,71
PAYS-BAS				
CIVITAS PROPERTIES FINANCE B V 4.0% 24-11-22	EUR	30 000 000	14 675 753,42	1,31
LA PERLA FASHION FINANCE BV 7.25% 29-03-23	EUR	1 000 000	437 042,35	0,04
TOTAL PAYS-BAS			15 112 795,77	1,35
PORTUGAL				
BANCO ESPIRITO SANTO S 2.625% 08/05/2017	EUR	1 500 000	387 180,00	0,03
BCO ESPI 4.75% 15-01-18 EMTN DEFAULT	EUR	1 600 000	431 200,00	0,04
PGB 3 7/8 02/15/30	EUR	4 000 000	5 595 466,58	0,50
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 4.125% 14-04-27	EUR	3 700 000	4 920 953,90	0,44
TOTAL PORTUGAL			11 334 800,48	1,01
TURQUIE				
REPU DE TURQ 4.875% 09-10-26	USD	12 500 000	10 896 648,36	0,97
TURKEY GOVERNMENT INTL BOND 6.125% 24-10-28	USD	33 500 000	30 918 267,42	2,76
TURKEY 5 3/4 03/22/24	USD	3 400 000	3 119 199,74	0,28
TURQUIE 6.25% 09/22	USD	13 000 000	12 275 790,38	1,09
TOTAL TURQUIE			57 209 905,90	5,10
TOTAL Obligations & val. ass. ng. sur mar. régl. ou ass.			681 013 632,32	60,67
Obligations et valeurs assimilées non négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
PAYS-BAS				
CHAIN FINANCE BV 7.75% 11-08-20	EUR	61 600 000	29 322 273,22	2,61
EVEREST MEDTECH BV 5.0% 29-01-24	EUR	10 000 000	4 186 986,30	0,37
TOTAL PAYS-BAS			33 509 259,52	2,98
TOTAL Oblig & valeurs ass. non négo. sur marchés régl.			33 509 259,52	2,98
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			714 522 891,84	63,65
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
FRANCE				
FRENCH REP ZCP 11-12-19	EUR	73 000 000	73 087 372,47	6,51
REPUBLIQUE FRANCAISE ZCP 161019	EUR	59 500 000	59 516 139,04	5,30
TOTAL FRANCE			132 603 511,51	11,81
ROYAUME UNI				
UNIT KING TREA BIL ZCP 21-10-19	GBP	15 000 000	16 947 831,56	1,51
UNITED KINGDOM OF GR ZCP 231219	GBP	15 000 000	16 926 273,15	1,51
TOTAL ROYAUME UNI			33 874 104,71	3,02
TOTAL Titres de créances négo. sur marchés régl. ou ass.			166 477 616,22	14,83
TOTAL Titres de créances			166 477 616,22	14,83

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
IRLANDE				
H2O Barry Active Val I EUR	EUR	46 280,87	4 840 053,38	0,43
H2O BARRY VOLATIBILITY ARBITRAGE FUND FOUNDER CLASS	EUR	70 000	7 611 800,00	0,68
TOTAL IRLANDE			12 451 853,38	1,11
LUXEMBOURG				
QUADRA CAPITAL EUROPEAN EQT ALPHA S -A-	EUR	8 800	9 420 576,00	0,84
SATELLITE EVENT-DRIVEN SEEDER	EUR	18 000	18 032 400,00	1,61
TOTAL LUXEMBOURG			27 452 976,00	2,45
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			39 904 829,38	3,56
Autres organismes non européens				
ILES CAIMANS				
POINCARE GLOBAL EQUITY MASTER FUND LTD	USD	5 740,275607	4 767 374,65	0,42
TOTAL ILES CAIMANS			4 767 374,65	0,42
TOTAL Autres organismes non européens			4 767 374,65	0,42
TOTAL Organismes de placement collectif			44 672 204,03	3,98
Titres mis en dépôt				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
BTPS 4 3/4 09/01/44	EUR	25 500 000	40 751 048,41	3,63
UK TSY 3.25% 22/01/2044	GBP	5 000 000	8 482 679,89	0,76
TOTAL Obligations & val. ass. ng. sur mar. régl. ou ass.			49 233 728,30	4,39
TOTAL Titres mis en dépôt			49 233 728,30	4,39
Titres donnés en pension				
ITALIE				
ITALIE 5%09-010325	EUR	30 000 000	37 689 247,25	3,36
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.0% 01-08-29	EUR	20 000 000	24 235 586,96	2,16
TOTAL ITALIE			61 924 834,21	5,52
MEXIQUE				
MEXICAN BONOS 10.0% 05-12-24	MXN	3 123 000	17 046 654,39	1,52
MEXICAN BONOS 7.5% 03-06-27 - PAYE TOUS LES 182 JOURS	MXN	2 620 000	12 929 014,93	1,15
MEXICAN BONOS 7.75% 29-05-31	MXN	800 000	4 027 550,46	0,36
MEXICAN BONOS 8.0% 07-12-23	MXN	600 000	2 989 351,12	0,27
MEXICAN BONOS 8.5% 31-05-29	MXN	1 450 000	7 688 172,72	0,68
TOTAL MEXIQUE			44 680 743,62	3,98
PORTUGAL				
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 4.125% 14-04-27	EUR	20 000 000	26 599 750,82	2,37
TOTAL PORTUGAL			26 599 750,82	2,37
TOTAL Titres donnés en pension			133 205 328,65	11,87

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Dettes représentatives des titres donnés en pension			-475 781 273,49	-42,38
Indemnités sur titres donnés en pension			-2 246 150,79	-0,20
Instruments financiers à terme				
Engagements à terme ferme				
Engagements à terme ferme sur marché réglementé ou assimilé				
ASD Index 1220	USD	100	8 140,71	
CBF CBOE VIX FU 0220	USD	-51	-23 403,96	
CBF CBOE VIX FU 1119	USD	-51	-12 864,61	
CBF CBOE VIX FU 1219	USD	-2	412,77	
CBOT USUL 30A 1219	USD	520	-2 759 812,32	-0,25
CME CME SP MID4 1219	USD	822	-2 557 980,19	-0,23
CME XAY CONS DI 1219	USD	209	-256 888,64	-0,02
CREDIT SUISSE 1219	CHF	750	-1 429,98	
EOE XAMS FTI AM 1019	EUR	-212	-254 340,00	-0,02
E-STOXX C&M 1219	EUR	-161	-75 267,50	-0,01
EUR DJE 600 EUR 1219	EUR	9 136	1 759 821,00	0,16
EUR DJE 600 HEA 1219	EUR	-274	-339 075,00	-0,03
EUR DJE 600 IND 1219	EUR	-1 136	194 185,00	0,02
EUR DJE 600 INS 1219	EUR	-3 122	-1 019 065,00	-0,09
EUR DJES BANKS 1219	EUR	155 788	-3 922 090,00	-0,35
EUR DJES TELECO 1219	EUR	2 368	568 045,00	0,05
EUR E-STOXX INS 1219	EUR	-1 417	-141 700,00	-0,01
EUR E-STOXX UTI 1219	EUR	99	70 290,00	0,01
EUR EUREX DIVID 1220	EUR	-12	-1 620,00	
EUR GR AXA D 10 1220	EUR	150	3 600,00	
EUR GR BASF 100 1220	EUR	80	4 400,00	
EUR GR BNP 1000 1220	EUR	450	41 000,00	
EUR GR CA DV 10 1220	EUR	300	-1 900,00	
EUR GR DAIML 10 1219	EUR	129	30 960,00	
EUR GR ENI 1000 1220	EUR	150	2 250,00	
EUR I2NN ING GR 1220	EUR	900	4 500,00	
EUR SOFFEX SMI 1219	CHF	-1 381	-1 215 343,57	-0,11
EUR STOXX 600 P 1219	EUR	-261	-74 390,00	-0,01
EUR UBS GROUP A 1220	CHF	750	4 254,44	
EUR VSTOXX FUTU 0220	EUR	326	33 925,00	
EUR VSTOXX FUTU 1219	EUR	-18	-1 224,00	
EUR XEUR A2S 1220	EUR	150	750,00	
EUR XEUR A2SG A 1219	EUR	500	8 750,00	
EUR XEUR FDAX D 1219	EUR	750	1 009 575,00	0,09
EUR XEUR FESX D 1219	EUR	4 624	2 261 860,00	0,20

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
EUR XEUR FGBX B 1219	EUR	-213	676 600,00	0,06
EUR XEUR FSTC D 1219	EUR	-247	-113 740,00	-0,01
EUR XEUR FSTM D 1219	EUR	-39	-10 920,00	
EUR XEUR FSTO D 1219	EUR	-1 560	-936 905,00	-0,08
EUR XEUR FSTT D 1219	EUR	722	74 005,00	0,01
EUR XEUR FSTY D 1219	EUR	-469	116 487,50	0,01
EUR XEUR I3ES I 1220	EUR	2 000	38 000,00	
EUR XEUR V4O VO 1219	GBP	3 500	-193 851,02	-0,02
EUREX DIVIDEN 1221	EUR	-197	-21 235,00	
FP MICHELIN 1 1220	EUR	23	-22 200,00	
FV CBOT UST 5 1219	USD	-24 253	15 634 961,50	1,40
GR BASF 1000 1219	EUR	48	5 280,00	
GR RENAU 1000 1220	EUR	120	-28 800,00	
JGBL JAPAN GO 1219	JPY	162	-31 827,31	
LIF LIFFE LG GI 1219	GBP	-99	-133 457,67	-0,01
LIF Z UKX - LON 1219	GBP	369	390 185,37	0,03
MFM MEFF IBEX35 1019	EUR	8	14 400,00	
MIF MTAA SPMI F 1219	EUR	23	44 045,00	
NIKEI 225 JPY 1219	JPY	-170	17 844,51	
NIKKEI Z9	JPY	30	45 958,63	
NK2 TOKYO NIK 1219	JPY	-579	-1 189 978,77	-0,11
NQ USA NASDAQ 1219	USD	343	-998 094,84	-0,09
OSE JN40 JPX NI 1219	JPY	6 691	2 052 762,26	0,18
OSE TSE TOPIX I 1219	JPY	2 172	7 316 882,25	0,65
RTY INDEX 50 1219	USD	-8 568	24 047 518,80	2,15
SFE XSFE AP S&P 1219	AUD	261	-5 908,19	
SP 500 MINI 0320	USD	-201	-393 569,07	-0,04
SP 500 MINI 1219	USD	-1 258	1 649 184,09	0,15
STX 50 DIV 1219	EUR	976	68 320,00	0,01
STX 50 DIV 1222	EUR	-1	-205,00	
TU CBOT UST 2 1219	USD	-1	598,38	
TY CBOT YST 1 1219	USD	-2 582	3 575 282,43	0,32
UBS GROUP AG 1219	CHF	250	10 348,63	
US US TBOND 3 1219	USD	599	-2 086 154,04	-0,19
VSTOXX MINI 0120	EUR	5	515,00	
VSTOXX MINI 0320	EUR	13	754,00	
XEUR FBTP BTP 1219	EUR	10 132	22 895 140,00	2,05
XEUR FGBL BUN 1219	EUR	-5 352	9 230 540,00	0,82
XEUR FGBM BOB 1219	EUR	-1 992	1 734 880,00	0,15

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
XEUR FGBS SCH 1219	EUR	-10 209	3 340 113,00	0,30
XEUR FSTA DJ STOXX 6	EUR	1 281	-378 685,00	-0,03
XEUR I3ES INT 1219	EUR	2 750	33 000,00	
XPAR FCE CAC 40 IND	EUR	12	2 190,00	
XSFE XT AUSTR 1219	AUD	1	885,92	
XSTO OMXS STO 1019	SEK	2 170	-4 017,63	
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé			79 815 457,88	7,11
TOTAL Engagements à terme fermes			79 815 457,88	7,11
Engagements à terme conditionnel				
Engagements à terme conditionnel sur marché de gré à gré				
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 PUT 3200	EUR	5 000	90 122,69	0,01
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 PUT 3250	EUR	5 000	6 022,46	
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 PUT 3300	EUR	7 000	57,22	
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 CALL 3500	EUR	5 000	282 965,28	0,02
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 CALL 3500	EUR	-2 500	-141 482,64	-0,01
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 CALL 3500	EUR	-2 500	-204 863,70	-0,02
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 PUT 3000	EUR	5 000	9 892,26	
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 PUT 3200	EUR	5 000	60 916,53	0,01
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 PUT 3200	EUR	-2 500	-30 458,26	
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 PUT 3300	EUR	5 000	24 595,81	
DJES BANKS 12/2019 CALL 100	EUR	50 000	17 006,50	
EUR/USD OTC 11/2019 CALL 1,16	EUR	100 000 000	12 156,55	
S&P 500 INDEX 10/2019 CALL 2700	USD	5 000	6 041,17	
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2800	USD	10 000	62 941,35	0,01
S&P 500 INDEX 11/2019 PUT 2800	USD	5 000	136 989,30	0,01
USD/TWD OTC 03/2020 PUT 30,1	USD	-19 000 000	-86 858,03	-0,01
TOTAL Engagements à terme conditionnels de gré à gré			246 044,49	0,02
Engagements à terme conditionnel sur marché réglementé ou assimilé				
ASML HLDG 03/2020 CALL 250	EUR	72	56 448,00	0,01
ASML HLDG 03/2020 PUT 210	EUR	72	74 016,00	0,01
AXA 03/2020 CALL 24	EUR	400	34 400,00	
AXA 03/2020 PUT 21	EUR	400	18 000,00	
BARC BANK P WR 01-48 10/2019 PUT 19	USD	-1 000	-3 669,05	
BARC BANK P WR 01-48 10/2019 PUT 22	USD	500	27 976,52	
BASF SE 03/2020 CALL 72	EUR	300	31 200,00	
BASF SE 03/2020 PUT 56	EUR	300	41 400,00	
BNP PARIBAS 03/2020 CALL 48	EUR	450	66 600,00	0,01
BNP PARIBAS 03/2020 PUT 42	EUR	450	85 050,00	0,01

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CBOE SPX VOLATILITY 10/2019 CALL 23	USD	1	55,04	
CBOE SPX VOLATILITY 11/2019 CALL 16	USD	550	176 573,11	0,02
CBOE SPX VOLATILITY 11/2019 CALL 23	USD	2 000	243 991,93	0,02
CBOE SPX VOLATILITY 11/2019 CALL 30	USD	-4 000	-238 488,35	-0,02
CBOE SPX VOLATILITY 11/2019 PUT 14	USD	-2 000	-51 366,72	
CBOE SPX VOLATILITY 11/2019 PUT 16	USD	-50	-4 494,59	
CBOE SPX VOLATILITY 11/2019 PUT 17	USD	500	67 877,45	0,01
CBOE SPX VOLATILITY 12/2019 CALL 18	USD	-2 080	-539 937,63	-0,05
CBOE SPX VOLATILITY 12/2019 CALL 23	USD	1 000	146 762,06	0,01
CBOE SPX VOLATILITY 12/2019 CALL 25	USD	2 500	293 524,12	0,03
CBOE SPX VOLATILITY 12/2019 CALL 30	USD	-2 000	-146 762,06	-0,01
CBOE SPX VOLATILITY 12/2019 PUT 14	USD	-4 000	-165 107,32	-0,01
CBOE SPX VOLATILITY 12/2019 PUT 15	USD	-2 500	-183 452,58	-0,02
CBOE SPX VOLATILITY 12/2019 PUT 18	USD	2 080	454 081,82	0,04
CBOT US TRES BD 30 A 10/2019 CALL 164	USD	-240	-182 306,00	-0,02
CREDIT SUISSE GROUP 03/2020 CALL 13	CHF	750	38 634,90	
CREDIT SUISSE GROUP 03/2020 CALL 14	CHF	1 625	41 854,48	
CREDIT SUISSE GROUP 03/2020 PUT 12	CHF	1 625	124 068,62	0,01
DAX Xetra 12/2019 PUT 10250	EUR	-50	-7 450,00	
DAX Xetra 12/2019 PUT 10400	EUR	-171	-29 925,00	
DEUTSCHE POST NAMEN 12/2019 PUT 28	EUR	-1	-36,00	
DIVIDND FUTURE EUREX 12/2019 CALL 122	EUR	-1 500	-54 000,00	
DIVIDND FUTURE EUREX 12/2019 PUT 120	EUR	-1 250	-13 750,00	
DIVIDND FUTURE EUREX 12/2020 PUT 100	EUR	-650	-3 900,00	
DIVIDND FUTURE EUREX 12/2020 PUT 107	EUR	-2 500	-27 500,00	
DIVIDND FUTURE EUREX 12/2020 PUT 110	EUR	1 125	14 625,00	
DIVIDND FUTURE EUREX 12/2021 CALL 120	EUR	875	352 625,00	0,03
DIVIDND FUTURE EUREX 12/2021 CALL 130	EUR	-1 000	-33 000,00	
DIVIDND FUTURE EUREX 12/2021 CALL 132	EUR	-375	-6 000,00	
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 CALL 3400	EUR	-62	-149 792,00	-0,01
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 CALL 3450	EUR	-50	-102 650,00	-0,01
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 CALL 3475	EUR	-75	-141 150,00	-0,01
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 CALL 3700	EUR	2 350	1 588 600,00	0,14
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 CALL 3750	EUR	350	173 250,00	0,02
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 CALL 3775	EUR	500	209 250,00	0,02
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 PUT 2500	EUR	-1 000	-80 000,00	-0,01
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 PUT 2800	EUR	-1 100	-214 500,00	-0,02
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 PUT 2900	EUR	3 000	777 000,00	0,07
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 PUT 3000	EUR	-5 550	-1 892 550,00	-0,17

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 PUT 3100	EUR	-600	-265 500,00	-0,02
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 PUT 3200	EUR	-3 100	-1 798 000,00	-0,16
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 PUT 3250	EUR	-412	-275 628,00	-0,02
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 PUT 3275	EUR	-500	-358 000,00	-0,03
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 PUT 3300	EUR	-2 350	-1 800 100,00	-0,16
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 PUT 3325	EUR	-75	-61 425,00	-0,01
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 PUT 3350	EUR	-300	-262 800,00	-0,02
DJ EURO STOXX 50 ' 03/2020 PUT 3500	EUR	2 500	3 286 250,00	0,29
DJ EURO STOXX 50 ' 06/2020 PUT 3000	EUR	-244	-155 428,00	-0,01
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 CALL 3600	EUR	-750	-180 000,00	-0,02
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 CALL 3650	EUR	3 280	226 320,00	0,02
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 CALL 3850	EUR	-1 125	-1 687,50	
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 PUT 2900	EUR	-3 125	-12 500,00	
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 PUT 2950	EUR	-1 000	-5 000,00	
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 PUT 3050	EUR	-750	-6 750,00	
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 PUT 3100	EUR	-2 500	-30 000,00	
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 PUT 3200	EUR	900	19 800,00	
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 PUT 3250	EUR	1 250	37 500,00	
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 PUT 3300	EUR	-125	-5 250,00	
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 PUT 3350	EUR	1 000	61 000,00	0,01
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 PUT 3375	EUR	250	18 375,00	
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 PUT 3400	EUR	250	22 500,00	
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 PUT 3425	EUR	700	77 700,00	0,01
DJ EURO STOXX 50 ' 10/2019 PUT 3450	EUR	750	103 500,00	0,01
DJ EURO STOXX 50 ' 11/2019 CALL 3750	EUR	350	17 150,00	
DJ EURO STOXX 50 ' 11/2019 PUT 3275	EUR	-750	-112 875,00	-0,01
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 CALL 3475	EUR	1 000	1 506 000,00	0,13
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 CALL 3600	EUR	-2 000	-1 463 000,00	-0,13
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 CALL 3725	EUR	500	117 250,00	0,01
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 CALL 3800	EUR	200	18 200,00	
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 PUT 2900	EUR	-1 500	-117 750,00	-0,01
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 PUT 3000	EUR	-1 750	-198 625,00	-0,02
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 PUT 3200	EUR	244	58 194,00	0,01
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 PUT 3250	EUR	1 000	288 000,00	0,03
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 PUT 3300	EUR	-1 500	-522 750,00	-0,05
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2019 PUT 3350	EUR	1 000	424 000,00	0,04
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2020 PUT 1300	EUR	-300	-6 300,00	
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2020 PUT 1600	EUR	400	21 600,00	
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2020 PUT 2800	EUR	-750	-567 750,00	-0,05

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
DJ EURO STOXX 50 ' 12/2020 PUT 3000	EUR	-750	-840 750,00	-0,07
DJES BANKS 06/2020 PUT 55	EUR	1 263	41 047,50	
DJES BANKS 06/2020 PUT 70	EUR	-361	-45 125,00	
DJES BANKS 10/2019 CALL 87,5	EUR	1 500	161 250,00	0,01
DJES BANKS 10/2019 CALL 92,5	EUR	4 100	102 500,00	0,01
DJES BANKS 10/2019 CALL 97,5	EUR	-7 750	-38 750,00	
DJES BANKS 12/2019 CALL 100	EUR	3 000	94 500,00	0,01
DJES BANKS 12/2019 CALL 102,5	EUR	-375	-7 500,00	
DJES BANKS 12/2019 CALL 105	EUR	4 000	56 000,00	
DJES BANKS 12/2019 CALL 110	EUR	3 500	17 500,00	
DJES BANKS 12/2019 CALL 115	EUR	232 200	580 500,00	0,05
DJES BANKS 12/2019 CALL 120	EUR	-102 700	-256 750,00	-0,02
DJES BANKS 12/2019 CALL 125	EUR	-132 000	-330 000,00	-0,03
DJES BANKS 12/2019 CALL 95	EUR	250	16 875,00	
DJES BANKS 12/2019 CALL 97,5	EUR	28 800	1 368 000,00	0,12
DJES BANKS 12/2019 PUT 65	EUR	-4 600	-46 000,00	
DJES BANKS 12/2019 PUT 70	EUR	-16 320	-367 200,00	-0,03
DJES BANKS 12/2019 PUT 75	EUR	-10 000	-425 000,00	-0,04
DJES BANKS 12/2019 PUT 80	EUR	-7 500	-637 500,00	-0,06
ENGIE SA 03/2020 CALL 15	EUR	1 375	107 250,00	0,01
ENGIE SA 03/2020 PUT 14	EUR	2 175	103 312,50	0,01
ENI SPA 03/2020 CALL 14,5	EUR	250	61 437,50	0,01
ENI SPA 03/2020 CALL 15	EUR	50	7 425,00	
ENI SPA 03/2020 PUT 13	EUR	50	8 712,50	
ENI SPA 03/2020 PUT 13,5	EUR	250	59 187,50	0,01
EUREX EURO BUND 10/2019 CALL 177	EUR	-300	123 000,00	0,01
EUREX EURO BUND 10/2019 PUT 172	EUR	-300	159 000,00	0,01
EUREX EURO BUND 10/2019 PUT 173,5	EUR	300	9 800,00	
EURO STOXX BANKS W1 10/2019 PUT 80	EUR	750	3 288 750,00	0,29
FRESENIUS 03/2020 CALL 46	EUR	400	63 400,00	0,01
FRESENIUS 03/2020 PUT 42	EUR	400	93 400,00	0,01
FTSE/XINHUA CHINA2 03/2020 CALL 42	USD	2 000	199 963,31	0,02
FTSE/XINHUA CHINA2 03/2020 PUT 38	USD	2 000	275 178,87	0,02
GR B3AY 1000 1219	EUR	55	4 675,00	
INFINEON TECHNOLOG 03/2020 CALL 20	EUR	1 020	37 740,00	
INFINEON TECHNOLOG 03/2020 PUT 17	EUR	510	98 940,00	0,01
ING GROEP NV 03/2020 CALL 10,4	EUR	1 505	49 665,00	
ING GROEP NV 03/2020 PUT 9,2	EUR	1 505	76 755,00	0,01
ISHARES BARCLAYS 10/2019 PUT 128	USD	1 000	2 751,79	

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ISHARES BARCLAYS 10/2019 PUT 133	USD	1 250	9 172,63	
ISHARES BARCLAYS 10/2019 PUT 136	USD	-500	-10 548,52	
ISHARES BARCLAYS 11/2019 PUT 133	USD	2 500	71 087,87	0,01
ISHARES BARCLAYS 11/2019 PUT 136	USD	-1 000	-62 373,88	-0,01
KONINKLIJKE AHOLD NV 03/2020 CALL 21	EUR	-1	-249,00	
KONINKLIJKE AHOLD NV 03/2020 PUT 19	EUR	-1	-26,00	
MERCK KGA 03/2020 CALL 110	EUR	5	1 520,00	
MERCK KGA 03/2020 PUT 100	EUR	5	2 152,50	
MUENCHEN RUECK 03/2020 CALL 240	EUR	67	60 970,00	0,01
MUENCHEN RUECK 03/2020 PUT 230	EUR	80	63 840,00	0,01
ORANGE 03/2020 PUT 13	EUR	1 500	40 500,00	
ORANGE 12/2019 CALL 15	EUR	1 500	21 000,00	
ROYA DUTC SHEL PLC 03/2020 CALL 26	EUR	1	157,00	
ROYA DUTC SHEL PLC 03/2020 CALL 28	EUR	819	48 321,00	
ROYA DUTC SHEL PLC 03/2020 PUT 24	EUR	701	37 854,00	
SEL SCT ENERGY 10/2019 CALL 64	USD	500	1 375,89	
SEL SCT ENERGY 10/2019 CALL 67	USD	-500	-1 375,89	
SEL SCT ENERGY 10/2019 CALL 70	USD	500	458,63	
SIEMENS AG-REG 03/2020 CALL 100	EUR	203	77 749,00	0,01
SIEMENS AG-REG 03/2020 PUT 92	EUR	203	79 982,00	0,01
S&P 500 INDEX 03/2020 CALL 3200	USD	250	318 175,56	0,03
S&P 500 INDEX 03/2020 PUT 2250	USD	-125	-157 654,56	-0,01
S&P 500 INDEX 03/2020 PUT 2500	USD	-375	-571 856,08	-0,05
S&P 500 INDEX 03/2020 PUT 2500	USD	-761	-2 313 992,85	-0,21
S&P 500 INDEX 03/2020 PUT 2750	USD	-300	-980 324,71	-0,09
S&P 500 INDEX 03/2020 PUT 2850	USD	150	1 293 340,67	0,12
S&P 500 INDEX 03/2020 PUT 2850	USD	-250	-1 060 585,21	-0,09
S&P 500 INDEX 03/2020 PUT 2900	USD	50	246 812,51	0,02
S&P 500 INDEX 03/2020 PUT 2900	USD	25	246 514,40	0,02
S&P 500 INDEX 06/2020 CALL 3150	USD	131	878 980,92	0,08
S&P 500 INDEX 06/2020 PUT 2500	USD	-175	-840 327,46	-0,07
S&P 500 INDEX 09/2019 CALL 3050	USD	-60	-275,18	
S&P 500 INDEX 09/2019 PUT 2700	USD	-244	-1 119,06	
S&P 500 INDEX 09/2019 PUT 2900	USD	83	380,66	
S&P 500 INDEX 10/2019 CALL 2950	USD	-70	-348 009,54	-0,03
S&P 500 INDEX 10/2019 CALL 2975	USD	-13	-44 478,08	
S&P 500 INDEX 10/2019 CALL 3015	USD	13	34 342,32	
S&P 500 INDEX 10/2019 CALL 3025	USD	38	41 130,07	
S&P 500 INDEX 10/2019 CALL 3050	USD	13	5 902,59	

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
S&P 500 INDEX 10/2019 CALL 3100	USD	50	3 439,74	
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2500	USD	-250	-5 503,58	
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2600	USD	-243	-21 175,01	
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2600	USD	-142	-39 075,40	
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2650	USD	-50	-6 650,16	
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2700	USD	-50	-10 456,80	
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2700	USD	-280	-31 205,28	
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2750	USD	-150	-50 908,09	
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2760	USD	-30	-28 343,42	
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2780	USD	-200	-49 348,74	
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2800	USD	63	36 117,23	
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2800	USD	-50	-63 979,09	-0,01
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2850	USD	50	48 844,25	
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2875	USD	50	112 135,39	0,01
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2900	USD	125	202 944,41	0,02
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2900	USD	50	134 379,01	0,01
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2925	USD	188	390 588,88	0,03
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2930	USD	25	49 302,88	
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2950	USD	25	66 157,59	0,01
S&P 500 INDEX 10/2019 PUT 2960	USD	30	123 830,49	0,01
S&P 500 INDEX 11/2019 CALL 3100	USD	50	40 130,25	
S&P 500 INDEX 11/2019 PUT 2725	USD	-25	-32 448,17	
S&P 500 INDEX 11/2019 PUT 2775	USD	-50	-88 515,87	-0,01
S&P 500 INDEX 11/2019 PUT 2800	USD	-32	-66 042,93	-0,01
S&P 500 INDEX 11/2019 PUT 2800	USD	-50	-137 360,12	-0,01
S&P 500 INDEX 12/2019 CALL 2900	USD	-62	-789 644,10	-0,07
S&P 500 INDEX 12/2019 CALL 2900	USD	-140	-893 331,50	-0,08
S&P 500 INDEX 12/2019 CALL 2960	USD	24	218 271,88	0,02
S&P 500 INDEX 12/2019 CALL 2965	USD	16	140 598,06	0,01
S&P 500 INDEX 12/2019 CALL 2985	USD	35	260 686,11	0,02
S&P 500 INDEX 12/2019 CALL 2995	USD	4	27 554,58	
S&P 500 INDEX 12/2019 CALL 3000	USD	-82	-542 304,16	-0,05
S&P 500 INDEX 12/2019 CALL 3005	USD	2	12 784,81	
S&P 500 INDEX 12/2019 CALL 3015	USD	-11	-64 070,81	-0,01
S&P 500 INDEX 12/2019 CALL 3020	USD	26	147 838,93	0,01
S&P 500 INDEX 12/2019 CALL 3100	USD	38	87 837,09	0,01
S&P 500 INDEX 12/2019 CALL 3130	USD	400	305 081,64	0,03
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2100	USD	-250	-19 835,81	
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2250	USD	-50	-14 217,57	

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2400	USD	-175	-97 917,81	-0,01
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2500	USD	850	787 470,19	0,07
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2550	USD	-150	-176 527,24	-0,02
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2600	USD	-263	-401 664,83	-0,04
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2700	USD	-105	-129 444,14	-0,01
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2700	USD	-457	-1 127 618,79	-0,10
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2750	USD	55	170 014,68	0,02
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2760	USD	-200	-323 335,17	-0,03
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2800	USD	175	673 385,62	0,06
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2850	USD	100	476 518,07	0,04
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2860	USD	-160	-398 092,09	-0,04
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2900	USD	-29	-170 243,99	-0,02
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2900	USD	-60	-176 114,47	-0,02
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2960	USD	-24	-180 187,12	-0,02
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2965	USD	-16	-118 290,22	-0,01
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2985	USD	-35	-291 185,10	-0,03
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 2995	USD	-4	-33 736,93	
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 3000	USD	82	726 206,20	0,06
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 3005	USD	-2	-18 088,42	
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 3015	USD	11	100 626,49	0,01
S&P 500 INDEX 12/2019 PUT 3020	USD	-26	-241 230,97	-0,02
S&P 500 INDEX 12/2021 PUT 2000	USD	160	893 780,96	0,08
S&P 500 INDEX 12/2021 PUT 2500	USD	-100	-1 405 246,74	-0,13
TELEFONICA 03/2020 CALL 7	EUR	2 750	85 250,00	0,01
TELEFONICA 03/2020 PUT 6,5	EUR	2 500	65 000,00	0,01
TOTAL 03/2020 CALL 50	EUR	1 151	158 838,00	0,01
TOTAL 03/2020 PUT 42	EUR	400	35 600,00	
TOTAL 03/2020 PUT 46	EUR	401	81 804,00	0,01
UNIB-RODAMCO-WEST 03/2020 CALL 140	EUR	50	23 150,00	
UNIB-RODAMCO-WEST 03/2020 PUT 130	EUR	50	29 850,00	
UTILITIES SELECT SEC 12/2019 PUT 55	USD	-500	-7 796,73	
UTILITIES SELECT SEC 12/2019 PUT 60	USD	500	24 307,47	
VSTOXX 10/2019 CALL 23	EUR	1 000	-27 500,00	
VSTOXX 10/2019 CALL 26	EUR	-1 000	20 000,00	
VSTOXX 12/2019 CALL 23	EUR	1 000	5 000,00	
VSTOXX 12/2019 CALL 30	EUR	-2 000	-5 000,00	
TOTAL Engagements à terme conditionnels sur marché réglementé			-1 093 549,55	-0,10
TOTAL Engagements à terme conditionnels			-847 505,06	-0,08

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Autres instruments financiers à terme				
Autres Swaps				
ABS DISP UBS	EUR	10 000 000	13 697,80	
ABSDISP 20 UBS	USD	70 000	-17 353,96	
ABSDS S20 BNP 190620	USD	5 000 000	11 985,78	
BNP UpVarsap 181220	USD	100 000	-145 571,25	-0,01
BNP Var swap 181220	USD	100 000	45 521,35	
CDS SX5E CS 181220	HKD	11 031 250	-75 003,45	-0,01
COR SWP KOSPI 121219	USD	75 000	117 422,93	0,01
COR SWP KOSPI 121219	USD	75 000	-93 109,43	-0,01
CORDISPGS 1946 17120	USD	63 750	13 791,32	
CORVSWP GS 131219	USD	175 000	95 374,11	0,01
CS HSI SG 301220	EUR	50 000	-53 500,00	
CS HSI SG 301220	EUR	50 000	-53 500,00	
CS SX7E 25.55 181220	EUR	75 000	-47 242,00	
CSD SX5E CS 181220	USD	280 000	11 139,57	
DCS 16.75 SG 190620	EUR	70 000	-24 218,63	
DCS 16.75 SG 190620	EUR	70 000	-24 218,63	
DCVS 15.6 BNP 121219	USD	75 000	-17 623,10	
DG SG 1804 181220	EUR	75 000	-24 000,00	
DG 18.04 SG 181220	EUR	75 000	-24 000,00	
DISP GE SG 190620	EUR	60 000	60 000,00	0,01
DISP GEO SWP 201219	EUR	175 000	99 750,00	0,01
DISP SWP BNP 210920	EUR	3 500 000	10 766,67	
DISP SWP SX5E 201219	EUR	75 000	51 752,62	
DISP UBS 190620	EUR	150 000	65 923,56	0,01
DISP VOLSWP SG 1495	USD	70 000	23 443,05	
DISP 29ML180621	USD	5 000 000	116 266,83	0,01
DISP 29ML180621	USD	5 000 000	116 266,83	0,01
DISPGEOSWP SG 190620	EUR	75 000	75 750,00	0,01
DISPSWP GS 17/01/20	USD	75 000	93 747,86	0,01
DISPVOLSWPSG2.5	USD	70 000	23 443,05	
disvol bnp 17.45 21	EUR	62 500	60 473,97	0,01
divswp8411 bnp060121	JPY	15 000 000	-1 087,58	
DS BNP 17.45 180621	EUR	62 500	60 473,97	0,01
DS SPX BNP 170120	USD	70 000	-5 204,90	
DS SPX BNP 170120	USD	70 000	-5 204,90	
DS SXXP BNP 171221	EUR	70 000	50 602,15	
DS 15.75 SG 201219	EUR	5 500	16 597,19	
DSV 16.77 ML 190620	USD	70 004	78 322,74	0,01

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
DSV 16.77 ML 190620	USD	70 004	78 322,74	0,01
DS1473 SG 170120	USD	50 000	11 286,71	
DS1473 SG 170120	USD	50 000	11 286,71	
DV S16.2 UBS 190620	USD	105 000	17 153,34	
DV S16.2 UBS 190620	USD	105 000	17 153,34	
DVS 15.6 ML 170120	USD	62 500	65 583,82	0,01
DVS 15.6 ML 170120	USD	62 500	65 583,82	0,01
DVS 17.064 SG 19062	EUR	87 500	-24 614,79	
DVS 17.064 SG 19062	EUR	87 500	-24 614,79	
FVA NKY UBS 101221	JPY	400 000	225 391,94	0,02
GDS BNP 181220	USD	105 000	-32 872,59	
GDS 17.27 UBS 190620	USD	165 000	-68 804,59	-0,01
GEO DIS BNP 181220	EUR	105 000	-35 837,70	
geo dis ubs 26.83 20	USD	62 500	-99 756,03	-0,01
GEO SWP GS 170120	USD	75 000	65 508,23	0,01
GEOD UBS 190620	USD	68 750	-71 570,24	-0,01
geodis bnp 16.6 21	EUR	250 000	-45 858,05	
GEODISCAPP SG201219	EUR	175 000	232 750,00	0,02
GEODISCAPSG20/12/19	EUR	140 000	182 000,00	0,02
GEODISP 18.39 201219	EUR	175 000	338 412,64	0,03
GEODISPSWP SG 190620	EUR	75 000	129 000,00	0,01
GEODIS2 UBS 26.83 20	USD	62 500	-99 756,03	-0,01
GEOS EB24453 190620	EUR	75 000	-38 416,42	
GEOVOLSW 17.25ML	EUR	125 000	-98 778,71	-0,01
GEOVOLSW 17.25ML	EUR	125 000	-98 778,71	-0,01
GEOVS BNP 190620	EUR	162 500	15 697,89	
GEOVS BNP 190620	EUR	87 500	-27 468,34	
GEVS GS 20.8 190620	USD	125 000	8 954,82	
GS COR DISP 170120	USD	75 000	34 087,77	
GS GEO DISSW 190620	EUR	66 000	54 943,24	
HIS hk index 201219	HKD	28 117,52	-787 685,41	-0,08
HSI VS UBS 290620	HKD	1 569 833,5	-199 707,56	-0,02
JPM N4 190620	USD	140 000	-68 221,06	-0,01
KOSPI VD18.5 121219	KRW	62 500	142,98	
KOSPI 200 INDEX	KRW	4 916 710,88	-546 156,50	-0,05
KOS200 DB 121219	USD	125 000	60 968,53	0,01
LU1144497093 280520	EUR	20 121 221,26	-784 460,82	-0,08
NKYSPX DB 111220	USD	125 000	-101 721,08	-0,01
NKYSPX DB 111220	USD	125 000	-103 938,42	-0,01

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Pairwise CS 181220	USD	217 657	54 959,64	
Pairwise CS 181220	USD	217 657	54 959,64	
PAL S13.5 JP 180920	EUR	7 000 000	25 365,13	
PINEEHA VOLSWP 4.15	EUR	70 000	116 875,07	0,01
PINEEHA VolSwp 4.25	EUR	70 000	113 928,05	0,01
SBS SCX5E JP 181220	EUR	105 000	-39 821,37	
SBS2 SX5E JPM 181220	EUR	105 000	-39 821,37	
SG GEO DISP DEC19 17	EUR	175 000	-346 500,00	-0,03
SINGLE INDXD0.36BNP	EUR	34 999 703,9	1 876 030,79	0,16
SINGLE INDXD0.49BNP	EUR	34 999 703,9	-1 874 343,81	-0,18
SINGLE INDXD28.5BNP	EUR	70 000 632	3 697 289,33	0,32
SINGLE INDXD43.5BNP	EUR	70 000 632	-4 090 054,09	-0,37
SINGLE PAIRDIS 2.5CS	USD	125 000	60 285,27	0,01
SINGLE PAIRDIS 2.5CS	USD	125 000	60 285,27	0,01
SPX CS 170120	USD	125 000	-2 561,92	
SPX CS 2 170120	USD	125 000	-2 561,92	
SPX ML 170120	USD	63 000	103 547,16	0,01
SXXP 15.34 NAT181220	EUR	50 000	-95 840,00	-0,01
SX5E Index 20/12/19	EUR	6 603,77	1 702 136,53	0,14
SX5E UBS 181220	EUR	83 337,5	89 838,15	0,01
SX5E UBS 181220 GBP	GBP	41 662,5	100 374,94	0,01
SX5EFVAC ML 171221	EUR	20 000	98 772,55	0,01
VAR SWAP STRIKE SG	HKD	14 500	-3 630,73	
VAR SWAP STRIKE SG	HKD	14 500	-3 630,73	
varswap sg 201219	USD	75 000	-193 313,15	-0,02
varswp 20.27 ubs 20	USD	75 000	-31 843,46	
VARSWPSPX DB 190620	USD	252 000	-157 601,80	-0,01
VD SX5E NAM 181220	EUR	75 000	-52 260,00	
VL ML S26.7 170120	USD	20 000	-16 875,03	
VL ML S26.7 170120	USD	25 000	-24 510,72	
VLML S17.3 170120	USD	20 000	55 869,60	
VLML S17.7 170120	USD	25 000	78 937,08	0,01
VLS 15.52 ML 170120	USD	70 000	18 022,07	
Vol Swap 4.15NAT	USD	70 000	112 595,85	0,01
VOLSWGLE32.5BAML	EUR	15 000	24 516,19	
volswp ubs 16.57 21	USD	100 000	71 835,60	0,01
volswpp gle jpm 1219	EUR	14 000	8 524,36	
VOLSWSX726.3BAML	EUR	15 000	-28 766,30	
VRS JPM 181220	USD	17 500	-10 833,81	

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
VRS JPM 190620	USD	70 000	-46 891,78	
VRS JPM 190620	USD	70 000	-46 891,78	
vrswp cs 180920	EUR	70 000	32 829,00	
Vrswp spx bnp 201218	USD	100 000	-176 510,80	-0,02
VS NKY ML 201219	JPY	11 383 200	-644 193,57	-0,06
VS DAX ML 201219	EUR	37 500	204 518,95	0,02
VS JP 181220	EUR	51 737	14 673,84	
VS JP 181220	EUR	51 737	14 673,84	
VS JP 181220	GBP	18 263	6 106,48	
VS JP 181220	GBP	18 263	1 328,52	
VS JP 201219	EUR	14 000	10 469,27	
VS SG SPX 170120	EUR	140 000	35 664,83	
VS SG SPX 170120	EUR	140 000	35 664,83	
VS SPX 147 JP 17011	USD	70 000	-1 264,07	
VS SPX 147 JP 17011	USD	70 000	-1 264,07	
VS SX5E NAM 181220	EUR	68 380	-46 238,56	
VS SX5E20.05 171221	EUR	73 000	92 155,88	0,01
VS SX5E20.55 171221	EUR	75 000	-22 497,03	
VS SX7E ML201219	EUR	15 000	9 088,64	
VS S15.76 JP 190620	USD	87 500	-46 321,78	
VS S15.76 JP 190620	USD	87 500	-46 321,78	
VS S1626 JPM 190620	USD	70 000	43 660,04	
VS S25.2 BNP 201219	EUR	14 000	858,61	
VS UKX ML 201219	GBP	48 000	334 908,16	0,03
VS UKX SG 181220	GBP	27 158	16 842,23	
VS 2.5 UBS 180621	USD	62 500	-24 872,57	
VS 2.5 UBS 180621	USD	62 500	-60 107,71	-0,01
VSD 16.26 CS 170120	USD	75 000	-27 847,18	
VSDAX JP 1697 190620	EUR	20 192	-962,62	
VSDAX1697 JP 190620	EUR	28 846	-1 375,19	
VSDSPX S159DB 171220	USD	140 000	56 879,67	0,01
VSS27.05 SG 301220	HKD	14 500	4 636,39	
VSS2705 SG2 301220	HKD	14 500	4 636,39	
VSUKX 1578 JP 190620	GBP	21 000	35 182,50	
VSUKX 1578 JP 190620	GBP	21 000	35 182,50	
VSWP SG 181019	USD	140 000	121 995,96	0,01
VS2015 SG NSD 170120	USD	50 000	-10 175,52	
VS2015 SG NSD 170120	USD	100 000	-20 351,03	
VS2.5 BNP201219	EUR	30 000	-7 141,82	

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
14.75 GeometricSG	EUR	140 000	81 200,00	0,01
16%VOLSWAP UBS	EUR	6 900	-2 316,02	
27% volswapUBS	EUR	6 900	-44 326,86	
3Y AS NAM 220322	USD	5 000 000	214 387,27	0,02
TOTAL Autres SWAPS			596 736,32	0,05
CFD				
AF GS AIR F 1230	EUR	182 617	-117 422,73	-0,01
AMUN AMUND SG 1230	EUR	-201 352	-849 049,15	-0,08
APAM APERA SG 1230	EUR	-39 501	-14 220,36	
ASP ADP SG 1230	EUR	-36 871	-224 913,10	-0,02
BALN BALOISE 1230	CHF	16 000	105 024,76	0,01
BRG BRAVOFLY 1230	CHF	34 818	182 561,49	0,02
CDFASHMO 1230	GBP	-534 503	-331 081,32	-0,03
CFD ACN ACCENT 1230	USD	-27 550	147 074,85	0,01
CFD ACS ACTI. 1230	EUR	20 322	16 991,17	
CFD ADP AU DAT 1230	USD	-11 284	72 182,56	0,01
CFD ALSTOM 1230	EUR	1 990	115,57	
CFD AMZN AMAZO 1230	USD	2 895	-123 630,51	-0,01
CFD AOS SMITH S 1230	USD	-54 679	-59 684,47	-0,01
CFD ASML HOLD CFD	EUR	-56 254	-1 406 350,00	-0,12
CFD BAYER AG CFD	EUR	88 205	-233 743,25	-0,02
CFD BKNG BOOK S 1230	USD	-981	3 419,37	
CFD BNP ZOETIS 1230	USD	-1 792	1 377,62	
CFD BOUYGUES 1230	EUR	11 328	18 630,03	
CFD BUREAU VER 1230	EUR	-133 907	20 215,83	
CFD BUZZI PRF 1230	EUR	113 478	52 663,20	
CFD CFD BMW 1230	EUR	321 189	1 215 728,24	0,11
CFD CFD GLENCOR 1230	GBP	-324 894	-32 451,15	
CFD CFD SG ADEV 1230	NOK	-20 069	17 829,21	
CFD CFD SG AMER 1230	USD	23 846	14 436,21	
CFD CFD SG DC/ 1230	GBP	581 088	-14 481,90	
CFD CFD SG DOW 1230	USD	16 231	15 441,93	
CFD CFD SG EURO 1230	GBP	-32 877	-44 594,10	
CFD CFD SG FIN 1230	EUR	308	19 096,00	
CFD CFD SG GENE 1230	EUR	2 771	-3 048,10	
CFD CFD SG GRAI 1230	USD	-18 957	-408 630,99	-0,04
CFD CFD SG HLDX 1230	SEK	9 147	-768,01	
CFD CFD SG IFX 1230	EUR	-789 713	-603 340,73	-0,05
CFD CFD SG KBC 1230	EUR	-87 585	-423 630,19	-0,04

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD CFD SG SHER 1230	USD	-416	-3 515,78	
CFD CFD SG TINC 1230	EUR	29 276	5 855,20	
CFD CFD SG UNIC 1230	EUR	456 371	27 382,26	
CFD CFD SG UNIT 1230	USD	13 311	50 426,00	
CFD CFD SG VAST 1230	EUR	2 032	1 219,20	
CFD CFD SG VERI 1230	USD	-1 440	-893,96	
CFD CFD SG YAMA 1230	JPY	30 400	-30 547,05	
CFD CFD SO BROA 1230	USD	816	960,38	
CFD CFD TUI SG 1230	GBP	40 016	-4 215,54	
CFD CHRW CHROB 1230	USD	-30 306	-8 061,59	
CFD COBHAM 1230	GBP	77 480	-4 072,36	
CFD CR SUISSE 1230	CHF	471 872	-34 776,17	
CFD CTXS CITRI 1230	USD	-58 889	-191 219,10	-0,02
CFD DANSKE BK 1230	DKK	174 048	-61 108,67	-0,01
CFD DE SAMM 1230	DKK	-8 598	23 722,59	
CFD DIAGEO 1230	GBP	21 168	7 841,75	
CFD DSM KONING 1230	EUR	-231	623,70	
CFD DUC SG INDU 1230	SEK	-1 547 556	-928 659,95	-0,08
CFD ECONB ECO S 1230	EUR	141 316	-58 222,19	-0,01
CFD EDP 1230	EUR	-954 414	-118 347,34	-0,01
CFD EL ESTEE SG 1230	USD	-2 904	-2 557,18	
CFD EUTELSAT 1230	EUR	-21 456	731,65	
CFD FAST FASTE 1230	USD	-81 795	-133 914,24	-0,01
CFD FDR FONCIE 1230	EUR	-17 012	-5 687,37	
CFD FFIV NETW S 1230	USD	-7 521	-80 646,20	-0,01
CFD FOX --- REG 1230	USD	14 995	-20 884,13	
CFD FRESENIU SG 1230	EUR	55 303	-70 102,23	-0,01
CFD F21 SG GL E 1230	EUR	8 432	-8 010,40	
CFD GAMESA CFD	EUR	13 500	877,50	
CFD GAS NAT. 1230	EUR	-13 569	-7 327,26	
CFD GIVAUDAN 1230	CHF	-160	-11 548,55	
CFD GLAXOSMIT 1230	GBP	-186 313	-59 878,30	-0,01
CFD G38 SG SIMC 1230	DKK	-34 521	138 708,19	0,01
CFD HIKMA PH. 1230	GBP	15 248	7 266,75	
CFD IMPERIAL 1230	GBP	-18 448	-3 023,58	
CFD ING GROEP 1230	EUR	-37 152	-10 231,66	
CFD INTERTEK 1230	GBP	26 813	-17 048,22	
CFD INT.HOT. 1230	GBP	-69 925	24 391,56	
CFD INTU INTUI 1230	USD	-2 586	53 181,18	

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD ITV PLC CFD	GBP	-449 400	-34 058,02	
CFD ITW ILLIN S 1230	USD	-16 826	-102 326,53	-0,01
CFD I12 SG BRAD 1230	USD	27 840	3 181,86	
CFD KLEPIERRE 1230	EUR	-16 388	-55 719,20	
CFD KOG KONGSGS 1230	NOK	38 053	43 025,96	
CFD LANXESS 1230	EUR	-12 655	-16 451,50	
CFD LOW LOWE SG 1230	USD	-25 444	52 278,99	
CFD LUFTHANSA 1230	EUR	227 719	136 631,40	0,01
CFD MA MASTER S 1230	USD	-1 917	24 467,03	
CFD MAR MARRIO 1230	USD	-20 094	31 149,20	
CFD MCO MOODY S 1230	USD	-13 023	128 414,28	0,01
CFD MELE MELEX 1230	EUR	-12 024	-70 340,40	-0,01
CFD ML DAIML 1230	EUR	604 093	1 760 931,10	0,17
CFD ML TENCENT 1230	USD	-14 369	-4 744,85	
CFD MMM 3M SG 1230	USD	-14 691	-36 114,36	
CFD MNST MONST 1230	USD	-10 525	5 889,06	
CFD MTD METTLE 1230	USD	-4 959	-216 563,92	-0,02
CFD MUENCHENE 1230	EUR	-8 032	-51 045,61	
CFD NKE NIKE SG 1230	USD	-26 098	-225 502,81	-0,02
CFD NVDA NVDIA 1230	USD	-31 710	-190 806,82	-0,02
CFD OSR OSRAM L 1230	EUR	-1 858	-4 263,55	
CFD PAYX PAYCH 1230	USD	-8 141	-8 139,96	
CFD PDCO PATTE 1230	USD	40 272	54 668,84	
CFD PENNON 1230	GBP	44 576	2 932,43	
CFD PRUDENTIA 1230	GBP	422	79,56	
CFD PSA PUBLIC 1230	USD	-9 857	176 037,23	0,02
CFD P41 SG FISE 1230	USD	-4 320	8 332,73	
CFD P90 SG BLIZ 1230	USD	-4 080	8 070,18	
CFD RECORDATI 1230	EUR	10 080	-12 098,02	
CFD REMY COIN 1230	EUR	591	272,21	
CFD RHI ROB HL 1230	USD	-45 203	-90 804,05	-0,01
CFD RICHEMONT 1230	CHF	-163 785	556 543,86	0,05
CFD RL POLO RL 1230	USD	884	5 781,43	
CFD RMD RESMED 1230	USD	-42 260	162 419,19	0,01
CFD ROCHE HLD 1230	CHF	56 215	1 024 812,51	0,09
CFD ROK ROCKW S 1230	USD	-15 551	-171 314,91	-0,02
CFD ROST ROSS S 1230	USD	-6 433	-22 658,89	
CFD ROYAL PHI 1230	EUR	-45 571	38 958,23	
CFD SAMPO 1230	EUR	-25 525	2 652,68	

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD SANDVIK 1230	SEK	331 333	104 685,95	0,01
CFD SAY SG ARYZ 1230	CHF	146 460	-15 776,35	
CFD SBK SG BANK 1230	EUR	-39 141	250,50	
CFD SCD DIOR SG 1230	EUR	67 231	-790 172,08	-0,07
CFD SCHRODERS 1230	GBP	93 321	838 688,71	0,07
CFD SCV SG COVE 1230	EUR	-12 728	-53 584,88	
CFD SC4 SG CARR 1230	EUR	-70 377	-22 508,60	
CFD S/D SG D. C 1230	EUR	-80 443	6 342,64	
CFD SDF KS SG 1230	EUR	-55 977	92 362,05	0,01
CFD SDT DE TEL 1230	EUR	-100 712	-21 955,22	
CFD SEF SG EURF 1230	EUR	-1 811	-18 110,00	
CFD SG ALTICE- 1230	EUR	413 520	326 680,80	0,03
CFD SG DWS GRP 1230	EUR	-88 548	-74 823,06	-0,01
CFD SG AAPLE IN 1230	USD	12 142	169 622,69	0,02
CFD SG ABERCROM 1230	USD	-3 390	-3 047,33	
CFD SG ABN AMRO 1230	EUR	59 697	-5 366,76	
CFD SG ACCOR 1230	EUR	-71 730	72 447,30	0,01
CFD SG ACE NOM 1230	USD	-1 408	-2 996,68	
CFD SG AEON CO 1230	JPY	-32 593	-26 694,41	
CFD SG AIR LIQU 1230	EUR	-15 647	-50 649,46	
CFD SG AISIN SE 1230	JPY	16 000	-46 174,12	
CFD SG AJINOMOT 1230	JPY	-18 824	-16 455,75	
CFD SG AKER A 1230	NOK	30 716	52 715,36	
CFD SG AKER BP 1230	NOK	-59 289	-9 576,74	
CFD SG AKZO NOB 1230	EUR	-17 908	-5 730,56	
CFD SG ALIGN TE 1230	USD	-5 341	10 729,03	
CFD SG ALL NIPP 1230	JPY	16 000	271,59	
CFD SG ALLERGAN 1230	USD	1 440	11 319,76	
CFD SG ALLIANT 1230	USD	-8 908	-12 828,44	
CFD SG ALPHABET 1230	USD	11 629	313 768,04	0,03
CFD SG ALTAMIR 1230	EUR	5 087	1 027,57	
CFD SG ALTRAN T 1230	EUR	302 027	-9 739,14	
CFD SG AMADEUS 1230	EUR	-88 571	180 684,84	0,02
CFD SG AMER TOW 1230	USD	2 096	9 241,19	
CFD SG AMERICAN 1230	USD	-15 112	-35 208,66	
CFD SG AMGEN 1230	USD	-18 980	263 059,81	0,02
CFD SG ANTHEM 1230	USD	-1 776	27 458,59	
CFD SG AON 1230	USD	-7 007	8 226,89	
CFD SG APTIV PL 1230	USD	-23 244	-90 613,65	-0,01

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD SG ARCELORM 1230	EUR	365 405	-67 965,33	-0,01
CFD SG ARKEMA 1230	EUR	10 032	27 255,12	
CFD SG ARTISAN 1230	USD	-16 766	-24 606,13	
CFD SG ASAHI BR 1230	JPY	-12 800	-19 826,67	
CFD SG ASSICURA 1230	EUR	-3 724	366,07	
CFD SG ASTON MA 1230	GBP	-62 496	22 353,43	
CFD SG ASTRAZ 1230	GBP	-95 187	61 327,67	0,01
CFD SG AT AND T 1230	USD	392 821	929 625,92	0,08
CFD SG ATLAS 1230	SEK	-12 529	-3 675,94	
CFD SG ATLAS B 1230	SEK	-55 799	-5 221,22	
CFD SG ATMOS EN 1230	USD	-4 492	-15 080,46	
CFD SG AUSAND N 1230	AUD	-160 285	-176 507,86	-0,02
CFD SG AXEL SPR 1230	EUR	-42 151	-12 645,30	
CFD SG AZIMUT 1230	EUR	-91 407	-109 231,37	-0,01
CFD SG BANCA GE 1230	EUR	-57 147	-73 148,16	-0,01
CFD SG BANK OF 1230	USD	-4 130	-11 933,13	
CFD SG BAXTER I 1230	USD	-2 560	-883,63	
CFD SG BECTON D 1230	USD	1 792	3 398,50	
CFD SG BEIERSDO 1230	EUR	-16 422	103 458,60	0,01
CFD SG BERKLEY 1230	USD	-5 270	-4 737,30	
CFD SG BHP GROU 1230	GBP	107 620	-49 388,18	
CFD SG BLACKROC 1230	USD	-29 361	-621 584,92	-0,06
CFD SG BOLLORE 1230	EUR	501 607	-38 313,11	
CFD SG BPOST 1230	EUR	-85 280	-44 037,95	
CFD SG BRIDGEST 1230	JPY	12 800	-11 972,49	
CFD SG BURBERRY 1230	GBP	-17 583	-1 484,32	
CFD SG CANON 1230	JPY	-30 058	-30 995,95	
CFD SG CAPITA 1230	GBP	-3 362 184	-630 328,54	-0,06
CFD SG CAPRI HO 1230	USD	3 924	24 403,52	
CFD SG CARLSBER 1230	DKK	-8 914	-13 132,97	
CFD SG CATERPIL 1230	USD	1 680	-8 428,66	
CFD SG CELLNEX 1230	EUR	22 898	30 685,11	
CFD SG CENTAMIN 1230	GBP	-1 101 762	241 598,09	0,02
CFD SG CENTRICA 1230	GBP	-1 107 824	-50 589,00	
CFD SG CF INDUS 1230	USD	4 592	110,78	
CFD SG CHUGAI P 1230	JPY	-6 400	-2 029,93	
CFD SG CHUGOKU 1230	JPY	-11 338	-3 079,32	
CFD SG CITIGROU 1230	USD	-3 216	3 350,81	
CFD SG CMS ENER 1230	USD	-10 291	709,03	

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD SG COCALA 1230	USD	-162 785	89 589,98	0,01
CFD SG COLAS 1230	EUR	307	-184,20	
CFD SG COMMONWE 1230	AUD	-84 988	-93 589,85	-0,01
CFD SG COMP DE 1230	EUR	-245	-2,45	
CFD SG COMPASS 1230	GBP	-16 236	-15 885,43	
CFD SG CONSOLID 1230	USD	-14 910	-65 535,30	-0,01
CFD SG CORNING 1230	USD	-110 974	-68 200,86	-0,01
CFD SG CRH PLC 1230	EUR	92 656	121 379,36	0,01
CFD SG CRODA IN 1230	GBP	7 776	6 857,51	
CFD SG D R HORT 1230	USD	-10 589	-31 469,79	
CFD SG DAI NIP 1230	JPY	-9 935	-41 486,00	
CFD SG DAILY 1230	GBP	-88 391	-41 962,50	
CFD SG DAIWA HO 1230	JPY	-17 600	7 832,22	
CFD SG DANONE 1230	EUR	-40 963	26 216,32	
CFD SG DELIVERY 1230	EUR	-18 553	96 475,60	0,01
CFD SG DENSO 1230	JPY	-12 800	-2 649,64	
CFD SG DENTSU 1230	JPY	16 000	23 764,39	
CFD SG DOMINION 1230	USD	-26 903	-84 148,99	-0,01
CFD SG DOVER CO 1230	USD	2 320	12 385,25	
CFD SG DTE ENER 1230	USD	-5 134	-15 540,45	
CFD SG DUKE ENE 1230	USD	-28 694	-82 118,22	-0,01
CFD SG DUPONT 1230	USD	-16 231	-50 321,76	
CFD SG DUTY FRE 1230	EUR	29 016		
CFD SG EAST JA 1230	JPY	-13 278	-21 975,36	
CFD SG EATON VA 1230	USD	-19 777	-32 834,68	
CFD SG ECOLAB 1230	USD	-8 940	67 816,73	0,01
CFD SG ELIA SYS 1230	EUR	18 972	-7 588,80	
CFD SG ELIS 1230	EUR	-82 426	1 606,08	
CFD SG EPIROC 1230	SEK	137 796	53 608,96	
CFD SG EPIROC A 1230	SEK	-141 587	-45 303,52	
CFD SG EUROTU 1230	EUR	-233 151	-228 487,98	-0,02
CFD SG EVERGY I 1230	USD	-11 495	-16 448,54	
CFD SG EVERSOUR 1230	USD	-2 832	-10 561,28	
CFD SG EVOLVA 1230	CHF	352 222	-10 692,05	
CFD SG EXOR NV 1230	EUR	176 943	-72 070,67	-0,01
CFD SG EXPEDITO 1230	USD	-61 969	-181 325,55	-0,02
CFD SG FABEGE 1230	SEK	-169 653	30 863,27	
CFD SG FACEBOOK 1230	USD	4 402	-53 496,29	
CFD SG FANUC J 1230	JPY	-69 441	-1 110 953,69	-0,10

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD SG FAST RET 1230	JPY	-11 751	-196 476,08	-0,02
CFD SG- FE UN 1230	USD	-4 576	2 420,22	
CFD SG FEDEX 1230	USD	1 488	-6 969,12	
CFD SG FERRA 1230	EUR	-32 399	-16 558,34	
CFD SG FGR FP 1230	EUR	-24 763	-21 791,44	
CFD SG FIAT CHR 1230	EUR	-278 684	68 003,76	0,01
CFD SG FNG NV 1230	EUR	17 736	-46 113,60	
CFD SG FORTUM 1230	EUR	84 426	141 835,68	0,01
CFD SG FOX CORP 1230	USD	7 120	-971,80	
CFD SG FRANKLIN 1230	USD	-195 227	-462 012,16	-0,04
CFD SG FRENESIUS1230	EUR	28 675	14 337,50	
CFD SG FRESN 1230	GBP	-57 298	36 786,78	
CFD SG FUJITSU 1230	JPY	-6 400	-24 552,01	
CFD SG GAM HOLD 1230	CHF	-106 208	19 871,87	
CFD SG GAP 1230	USD	5 936	8 548,45	
CFD SG GENERAL 1230	AUD	-547 234	77 866,75	0,01
CFD SG GFS 1230	GBP	-102	-17,64	
CFD SG GLOBAL F 1230	EUR	72 854	-20 590,31	
CFD SG GOLDMAN 1230	GBP	-638 040	-20 742,13	
CFD SG GRUPO EZ 1230	EUR	196 744	491,86	
CFD SG GUESS 1230	USD	8 792	3 709,70	
CFD SG GUNNEBO 1230	SEK	128 245	4 615,71	
CFD SG HAMMERSO 1230	GBP	-16 006	-12,66	
CFD SG HANKYU 1230	JPY	-10 887	-12 936,15	
CFD SG HEXAGONA 1230	SEK	-54 781	-197 270,88	-0,02
CFD SG HILTON W 1230	USD	-19 690	-13 365,07	
CFD SG HITACHI 1230	JPY	-14 400	-48 153,44	
CFD SG HOLCIM 1230	CHF	-155 233	-80 263,82	-0,01
CFD SG HONDA 1230	JPY	22 400	-17 634,56	
CFD SG ICA GRUP 1230	SEK	-46	-36,87	
CFD SG ICADE 1230	EUR	8 969	14 350,40	
CFD SG IMERYS 1230	EUR	-11 832	2 603,04	
CFD SG INBEV 1230	EUR	-67 174	-81 952,28	-0,01
CFD SG INDUA SS 1230	SEK	357 315	13 204,84	
CFD SG INPEX - 1230	JPY	57 600	35 247,34	
CFD SG INTERVES 1230	EUR	11 409	-1 711,35	
CFD SG INTES 1230	EUR	-1 041 521	-124 549,23	-0,01
CFD SG INTUITIV 1230	USD	-1 264	-17 026,54	
CFD SG INVESTOR 1230	SEK	42 621	41 285,52	

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD SG JANUS HE 1230	USD	-23 311	-71 630,76	-0,01
CFD SG JAPAN P 1230	JPY	-18 659	-12 510,77	
CFD SG JAPAN P 1230	JPY	-61 585	-15 157,99	
CFD SG JAPAN T 1230	JPY	-52 281	-33 597,72	
CFD SG JUPITER 1230	GBP	-153 766	-23 811,39	
CFD SG KAMIGUMI 1230	JPY	-12 567	4 373,05	
CFD SG KAZ MINE 1230	GBP	-71 837	-24 765,79	
CFD SG KBC ANCO 1230	EUR	21 562	103 066,36	0,01
CFD SG KEIHAN 1230	JPY	-11 089	-33 410,99	
CFD SG KIMCO RE 1230	USD	-22 336	-12 610,37	
CFD SG KINNEVIK 1230	SEK	9 028	-5 874,03	
CFD SG KINNEVIK 1230	SEK	117 797	-148 973,71	-0,01
CFD SG KINTETSU 1230	JPY	-16 342	-35 498,85	
CFD SG KIRIN HO 1230	JPY	27 200	48 718,09	
CFD SG KLOECKNE 1230	EUR	-371 139	-44 536,68	
CFD SG KUBOTA 1230	JPY	36 800	4 789,17	
CFD SG KUEHNE 1230	CHF	-12 288	7 004,46	
CFD SG KYUS RA 1230	JPY	-6 294	-13 888,93	
CFD SG LA FONDI 1230	EUR	-347 120	-29 160,90	
CFD SG LAM RESE 1230	USD	-944	4 802,52	
CFD SG LAS VEGA 1230	USD	-62 522	-131 329,46	-0,01
CFD SG LEGG MAS 1230	USD	-23 006	-29 543,57	
CFD SG LEND LEA 1230	AUD	-201 119	-62 212,01	-0,01
CFD SG LIBERBAN 1230	EUR	1 395 577	-50 240,77	
CFD SG LINDE PL 1230	EUR	4 560	24 339,72	
CFD SG LINDT 1230	CHF	-25	-27 596,36	
CFD SG LISI 1230	EUR	-22 698	-306,93	
CFD SG LONZA 1230	CHF	2 368	1 277,67	
CFD SG LULULEMO 1230	USD	1 253	9 033,74	
CFD SG LUNDBERG 1230	SEK	-42 654	-16 252,01	
CFD SG L3HARRIS 1230	USD	-1 101	-470,38	
CFD SG MACQUARI 1230	AUD	-222 231	46 744,95	
CFD SG MACQUARI 1230	AUD	-19 027	-85 223,63	-0,01
CFD SG MAN GROU 1230	GBP	-420 932	-38 539,04	
CFD SG MARSH AN 1230	USD	11 200	1 696,73	
CFD SG MASMOVIL 1230	EUR	60 000	1 200,00	
CFD SG MEDTRONI 1230	USD	-4 144	7 439,22	
CFD SG MERLIN 1230	GBP	122 500	969,26	
CFD SG METLIFE 1230	USD	269 336	706 568,48	0,06

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD SG METRO BA 1230	GBP	22 396	-17 416,58	
CFD SG MICRO 1230	GBP	-797	-252,24	
CFD SG MICROCHI 1230	USD	32	55,31	
CFD SG MICROSOFT 1230	USD	-35 033	-43 079,82	
CFD SG MILLENIUM 1230	GBP	92 449	9 404,78	
CFD SG MIRVAC G 1230	AUD	-1 252 739	100 752,33	0,01
CFD SG MITSUBISHI 1230	JPY	208 000	15 128,39	
CFD SG MITSUBISHI 1230	JPY	-25 313	-51 561,26	
CFD SG MLLICOM 1230	SEK	-22 162	46 312,98	
CFD SG MOBB 1230	EUR	7 000	-6 440,00	
CFD SG MOLSONOR 1230	USD	-4 352	-22 754,39	
CFD SG MONCLER 1230	EUR	-13 796	19 176,44	
CFD SG MONDELEZ 1230	USD	-4 128	-3 596,00	
CFD SG MONTEA S 1230	EUR	5 457	13 096,80	
CFD SG MORPHOSY 1230	EUR	3 904	-16 600,59	
CFD SG MTU AERO 1230	EUR	1 728	9 291,11	
CFD SG NATIONAL 1230	EUR	-60	-9,30	
CFD SG NATL AUS 1230	AUD	-167 651	-242 701,89	-0,02
CFD SG NEC COR 1230	JPY	-9 196	-780,49	
CFD SG NESTLE 1230	CHF	-268 545	671 918,31	0,06
CFD SG NETFLIX 1230	USD	17 305	-343 915,38	-0,03
CFD SG NEXTERA 1230	USD	-17 343	-211 271,78	-0,02
CFD SG NIPPON 1230	JPY	-28 800	14 183,98	
CFD SG NISSIN 1230	JPY	-13 052	-56 686,06	-0,01
CFD SG NOKIA OY 1230	EUR	-253 485	-38 149,49	
CFD SG NOMURA 1230	JPY	132 800	33 587,91	
CFD SG NORWEGIA 1230	NOK	174 516	-7 223,42	
CFD SG NTT DAT 1230	JPY	36 800	-10 847,16	
CFD SG OCADO 1230	GBP	421 090	93 486,12	0,01
CFD SG ONO PHAR 1230	JPY	28 800	2 117,33	
CFD SG ORACLE 1230	USD	113 604	295 234,74	0,03
CFD SG ORIX 1230	JPY	-68 800	74 085,82	0,01
CFD SG ORPEA 1230	EUR	-3 600	-345,67	
CFD SG OSAKA GA 1230	JPY	-15 658	-21 927,49	
CFD SG OUTOKUMP 1230	EUR	-302 116	-62 235,90	-0,01
CFD SG PANASONI 1230	JPY	-64 000	14 844,62	
CFD SG PARQ RE 1230	EUR	49 998	999,96	
CFD SG PEARSON 1230	GBP	-311 378	229 624,80	0,02
CFD SG PERKINEL 1230	USD	-39 067	-79 793,63	-0,01

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD SG PETROL B 1230	USD	18 560	15 492,20	
CFD SG PFIZER 1230	USD	336 186	117 180,96	0,01
CFD SG PHOENIX 1230	GBP	-52	-26,03	
CFD SG PIRELLI 1230	EUR	-232 811	-163 666,13	-0,01
CFD SG PIXIUM V 1230	EUR	61 534	-7 630,22	
CFD SG PLAYTECH 1230	GBP	-105 466	-66 042,91	-0,01
CFD SG PNC BANK 1230	USD	-3 392	-16 154,25	
CFD SG PRICE TR 1230	USD	-150 990	-502 746,01	-0,04
CFD SG PROC GAM 1230	USD	-132 612	-504 806,27	-0,04
CFD SG PROMOTOR 1230	EUR	-29 923	-1 196,92	
CFD SG PROP 1230	GBP	-1 243 205	-58 998,56	-0,01
CFD SG PRUDENTI 1230	USD	165 342	1 495 388,11	0,14
CFD SG QUALCOMM 1230	USD	-24 475	33 450,51	
CFD SG RAYTHEON 1230	USD	-1 104	4 560,00	
CFD SG RBS 1230	GBP	220 640	7 045,24	
CFD SG RED ELEC 1230	EUR	-20 274	-10 339,74	
CFD SG RENAULT 1230	EUR	213 005	63 683,31	0,01
CFD SG RENISHAW 1230	GBP	-11 995	-15 456,43	
CFD SG RENREDES 1230	EUR	185 672	1 856,72	
CFD SG REPUBLIC 1230	USD	-6 110	15 132,09	
CFD SG RESONA 1230	JPY	99 400	38 807,25	
CFD SG REXEL SA 1230	EUR	37 632	-1 708,49	
CFD SG RIGHTMOV 1230	GBP	1 890	322,58	
CFD SG ROHM CO 1230	JPY	8 000	45 491,83	
CFD SG ROLLS 1230	GBP	2	0,47	
CFD SG SAAB AB 1230	SEK	31 015	23 147,68	
CFD SG SAIPEM S 1230	EUR	-31 067	5 343,52	
CFD SG SALVATOR 1230	EUR	-30 765	12 767,48	
CFD SG SBM OFFS 1230	EUR	-134 869	-2 697,38	
CFD SG SCENTRE 1230	AUD	-721 093	49 072,15	
CFD SG SCHAEFFL 1230	EUR	-86 053	-75 210,32	-0,01
CFD SG SCHIBS 1230	NOK	-33 349	20 847,63	
CFD SG SCHINDLE 1230	CHF	4 112	-23 566,21	
CFD SG SCHRODER 1230	GBP	-153 082	-475 038,11	-0,04
CFD SG SCOTTISH 1230	GBP	-29 078	4 242,50	
CFD SG SCOUT24 1230	EUR	-18 189	27 283,50	
CFD SG SEADRILL 1230	NOK	-1	0,10	
CFD SG SECOM 1230	JPY	-8 085	-1 213,19	
CFD SG SEGRO LN 1230	GBP	-23 344	-12 211,60	

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD SG SEVEN AN 1230	JPY	-45 954	-146 259,21	-0,01
CFD SG SE000017 1230	SEK	37 003	3 611,97	
CFD SG SE000992 1230	SEK	69 964	-81 715,07	-0,01
CFD SG SHIMANO 1230	JPY	-3 377	-28 948,17	
CFD SG SHIN-ETS 1230	JPY	-4 800	-34 424,42	
CFD SG SIKA AG 1230	CHF	12 496	11 291,85	
CFD SG SIPEF NV 1230	EUR	-416	-1 456,00	
CFD SG SOCI FON 1230	EUR	65 732	950 182,42	0,08
CFD SG SOFTBAN 1230	JPY	11 200	-20 530,05	
CFD SG SOUTHERN 1230	USD	3 616	14,92	
CFD SG SOUTH32 1230	GBP	-516 000	22 630,04	
CFD SG SPIE 1230	EUR	-5 161	-9 651,07	
CFD SG ST GOBAI 1230	EUR	24 124	18 027,51	
CFD SG STOCKLAN 1230	AUD	-484 350	-8 989,42	
CFD SG SUNTORY 1230	JPY	-5 755	-1 953,77	
CFD SG SWISS LI 1230	CHF	1 792	5 533,92	
CFD SG SWISS RE 1230	CHF	-8 096	-1 100,51	
CFD SG SWISSCOM 1230	CHF	300	134,17	
CFD SG SZG 1230	EUR	-126 620	139 915,10	0,01
CFD SG TECHNICO 1230	EUR	-933 968	-3 783,70	
CFD SG TELE DEU 1230	EUR	-1 093 232	-264 562,14	-0,02
CFD SG TEMENOS 1230	CHF	-27 311	6 775,94	
CFD SG TERUMO 1230	JPY	-16 000	-7 229,02	
CFD SG TESLA MO 1230	USD	-16 732	-234 205,03	-0,02
CFD SG TF1 1230	EUR	93 283	10 162,78	
CFD SG THE MACE 1230	USD	7 568	3 867,38	
CFD SG THYSSENK 1230	EUR	801 223	1 277 875,38	0,12
CFD SG TIKEHAU 1230	EUR	58 532	140 019,68	0,01
CFD SG TOBU RA 1230	JPY	-8 582	-17 481,09	
CFD SG TOKIO 1230	JPY	-24 000	26 282,01	
CFD SG TOKYO EL 1230	JPY	70 000	13 664,52	
CFD SG TOKYO EL 1230	JPY	3 200	10 684,18	
CFD SG TOKYO GA 1230	JPY	-34 092	-11 284,59	
CFD SG TOKYU 1230	JPY	-20 719	-22 684,39	
CFD SG TOPPAN P 1230	JPY	-28 800	-1 757,99	
CFD SG TORAY I 1230	JPY	-130 819	-16 838,78	
CFD SG TOTAL SY 1230	USD	-1 664	3 252,32	
CFD SG TOYOTA I 1230	JPY	11 200	-16 549,70	
CFD SG TRANSGEN 1230	EUR	154 457	26 257,69	

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD SG TRAVIS P 1230	GBP	-46 704	46 894,42	
CFD SG UBI BANC 1230	EUR	-473 840	-138 058,74	-0,01
CFD SG UBISOFT 1230	EUR	-12 582	88 325,64	0,01
CFD SG UCN CNHI 1230	EUR	-273 407	11 932,57	
CFD SG UGI 1230	USD	-7 732	-11 347,64	
CFD SG UNICREDI 1230	EUR	241 624	-14 833,55	
CFD SG UNILEVER 1230	EUR	-135 822	175 210,38	0,02
CFD SG US14149Y 1230	USD	15 808	33 522,23	
CFD SG US28176E 1230	USD	992	1 586,18	
CFD SG VALLOURE 1230	EUR	-323 795	41 445,76	
CFD SG VENTAS 1230	USD	-3 024	2 543,95	
CFD SG VICINITY 1230	AUD	-547 578	6 775,28	
CFD SG VISA INC 1230	USD	1 232	-3 749,00	
CFD SG VISTEON 1230	USD	-32 646	-413 240,51	-0,04
CFD SG VOEST 1230	EUR	-137 616	-17 890,08	
CFD SG VOLVO B 1230	SEK	325 315	-22 874,54	
CFD SG WALT DIS 1230	USD	23	-146,41	
CFD SG WASTE CO 1230	USD	-10 009	-918,09	
CFD SG WASTE MA 1230	USD	-15 231	60 773,12	0,01
CFD SG WEC ENER 1230	USD	-11 221	-3 807,31	
CFD SG WEIR 1230	GBP	-516	494,60	
CFD SG WEST JA 1230	JPY	-13 039	-13 134,92	
CFD SG WESTPAC 1230	AUD	-163 008	-143 201,78	-0,01
CFD SG WH SMITH 1230	GBP	-31 162	-10 214,74	
CFD SG WYNN RES 1230	USD	-30 256	39 686,37	
CFD SG ZOZO INC 1230	JPY	23 628	74 198,87	0,01
CFD SG ZUMTO 1230	EUR	6 700	2 948,00	
CFD SGA AENA SG 1230	EUR	-57 595	-234 691,55	-0,02
CFD SGJ CIB UN 1230	USD	-4 384	4 108,54	
CFD SGK SG HEIA 1230	EUR	-45 756	-106 471,09	-0,01
CFD SGL SG GALP 1230	EUR	-243 077	-185 953,91	-0,02
CFD SGP COMP GL 1230	EUR	1 318 883	44 314,47	
CFD SGP RUUKI G 1230	EUR	31 639	-411,31	
CFD SGP STNT FP 1230	EUR	100 474		
CFD SGS NOM 1230	CHF	-1 285	-31 324,23	
CFD SKANSKA A CFD	SEK	57 878	47 058,00	
CFD SMITH NEP 1230	GBP	119 200	-8 084,10	
CFD SNAM RETE SG 123	EUR	89 664	6 778,60	
CFD S_O SG ONTE 1230	EUR	72 041	102 796,34	0,01

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD SOK SG HEIO 1230	EUR	-11 245	-15 743,00	
CFD SRA SG RAND 1230	EUR	18 416	-15 901,98	
CFD SRI ERICSS 1230	SEK	173 812	19 174,95	
CFD SSABA SSAB 1230	SEK	-496 198	-2 980,17	
CFD SSO SG SODE 1230	EUR	-3 322	332,20	
CFD SSU SG ERST 1230	EUR	7 024	81,48	
CFD STE GALE 1230	EUR	37 174	76 881,73	0,01
CFD ST4 SG TELE 1230	EUR	-37 450	76 398,00	0,01
CFD SUEZ ENV 1230	EUR	319 101	95 730,30	0,01
CFD SVENSKA 1230	SEK	95 545	7 005,48	
CFD TAKEDA 1230	JPY	9 865	8 372,70	
CFD TELECOM ITA CFD	EUR	-2 798 889	-22 046,84	
CFD TELECOM 1230	EUR	-78 637	-3 011,80	
CFD THERMO 1230	USD	752	-906,16	
CFD TJX TJX CO 1230	USD	-27 740	-19 592,55	
CFD TOTAL 1230	EUR	-25 215	-4 446,79	
CFD TXN TEXAS S 1230	USD	-44 133	-222 243,78	-0,02
CFD T97 SG BB N 1230	USD	-4 272	-649,70	
CFD UBS ABB 1230	CHF	-117 696	-65 093,78	-0,01
CFD UBS SIE 1230	EUR	-24 373	-177 922,90	-0,02
CFD UBS STMIC 1230	EUR	-89 805	-144 137,03	-0,01
CFD UBS STORA 1230	EUR	38 624	17 848,15	
CFD ULTA ULTAB 1230	USD	-3 464	-41 051,99	
CFD UMI UMICOR 1230	EUR	-39 248	-222 143,68	-0,02
CFD UPM-KYMME 1230	EUR	-16 064	-23 103,24	
CFD VAR VARIAN 1230	USD	-19 099	-214 600,40	-0,02
CFD VEOLIA 1230	EUR	447 582	675 848,82	0,06
CFD VERBUN 1230	EUR	34 953	-138 064,35	-0,01
CFD VERIZON 1230	USD	244 511	493 417,90	0,04
CFD VNA VONNOVI 1230	EUR	-8 000	-4 404,00	
CFD V81 SG CINC 1230	USD	-1 984	-6 522,89	
CFD V82 SG COLG 1230	USD	3 120	3 126,30	
CFD WENDEL IN 1230	EUR	-12 995	-9 126,33	
CFD WHITBREAD 1230	GBP	59 482	-53 114,93	
CFD 1SE SG EQUI 1230	USD	-19 264	-8 304,97	
CFD 2GN SG SIDE 1230	USD	64 160	-20 909,97	
CFDKCR KONECR 1230	EUR	-41 472	-99 118,08	-0,01
CSA SG ADECCO 1230	CHF	-16 416	-13 270,19	
DAL DELTA AIR 1230	USD	35 715	-8 517,61	

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
DEQ DEAG 1230	EUR	14 224	-590,30	
ELISA ELIS SG 1230	EUR	-37 327	-57 483,58	-0,01
EQUINOR ASA 12/30	NOK	-78 914	-137 425,32	-0,01
GEA SG G1A 1230	EUR	-19 482	15 676,49	
GVW VESTAS W 1230	DKK	3 000	13 380,21	
GY CIN. CON. 1230	EUR	-13 658	-8 741,12	
H HYATT HOT 1230	USD	-25 304	-35 279,84	
HENKEL SG HEN 1230	EUR	-78 735	53 463,29	
IBE SG IBERDR 1230	EUR	-775 180	-142 633,12	-0,01
KEB KESKO SOG 1230	EUR	-6 256	903,99	
KER SG KERING 1230	EUR	-14 755	-395 562,77	-0,04
KN SG NATIXIS 1230	EUR	999 079	242 353,41	0,02
KONE SG KNE 1230	EUR	-73 980	38 984,01	
LHN LAFAR SG 1230	EUR	2 896	6 371,20	
LR SG LEGRAND 1230	EUR	-1 994	-2 512,44	
MC SG LVMH 1230	EUR	-98 641	575 742,14	0,05
PERNOD 1230	EUR	-37 371	344 833,68	0,03
PSM PROSIE 1230	EUR	-8 715	-5 795,48	
RF_ EURAZEO 1230	EUR	37 999	105 867,78	0,01
RMG ROYAL MA 1230	GBP	-323 552	20 175,95	
SAD SG ADIDAS 1230	EUR	-49 683	-775 907,43	-0,07
SAH SG ASHTEAD 1230	GBP	33 440	-12 139,36	
SAI SG AIRBUS 1230	EUR	-16 949	84 813,50	0,01
SA6 SG ALTC-A 1230	EUR	775 588	512 802,15	0,05
S_B SG BNP P 1230	EUR	-8 959	222,18	
SBC HSBC SG 1230	GBP	-220 014	-45 757,33	
SCB COM BK SG 1230	EUR	-119 254	13 725,74	
SCHINDLER SG 1230	CHF	-21 810	64 420,04	0,01
SC6 SG CAPGEM 1230	EUR	-30 800	31 815,12	
SDB SG D BK 1230	EUR	-108 912	9 529,54	
SE1 SG ELIOR 1230	EUR	-56 759	-34 622,99	
SG ACERINOX 1230	EUR	-72 326	-22 999,67	
SG AEDIFICA 1230	EUR	5 822	19 794,80	
SG AIXTRON 1230	EUR	8 900	3 417,60	
SG ALLIANZ 1230	EUR	-76 105	-948 928,40	-0,08
SG ANGLO AMER 1230	GBP	-99 975	-109 614,28	-0,01
SG ATOS 1230	EUR	5 771	-24 238,20	
SG AXA 1230	EUR	518 600	1 182 332,57	0,11
SG BANC POPO 1230	EUR	-1 276 288	8 755,53	

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SG BANCO NT 1230	EUR	-2 384 124	-668 901,19	-0,06
SG BARCLAYS 1230	GBP	7 264	158,47	
SG BBVA 1230	EUR	2 010 037	580 362,67	0,05
SG BCP BCO 1230	EUR	-4 105 584	10 462,02	
SG BIA GBP 1230	GBP	967 612	499 535,40	0,04
SG BK AMERIC CFD	USD	7 616	-6 786,08	
SG BKIA BANKI 1230	EUR	39 791	2 355,63	
SG BP/ LN 1230	GBP	-219 230	15 982,40	
SG BUZZI 1230	EUR	-74 446	-120 917,34	-0,01
SG CAIXA 1230	EUR	1 476 661	477 175,22	0,04
SG CAPITAL CO 1230	GBP	-361 097	-124 079,90	-0,01
SG CARBON 1230	EUR	15 527	-2 018,51	
SG CASINO 1230	EUR	-40 765	-56 171,30	-0,01
SG DASSAULT 1230	EUR	-32 965	-45 791,66	
SG DECAUX 1230	EUR	-33 627	-17 486,04	
SG DKSH SDK 1230	CHF	-19 094	-26 534,50	
SG DNB ASA 1230	NOK	22 944	-9,27	
SG DUFREY 1230	CHF	-26 601	-79 281,80	-0,01
SG ENEL SPA 1230	EUR	-635 482	-163 318,87	-0,01
SG ENI SPA 1230	EUR	-125 680	-13 482,68	
SG ERAMET 1230	EUR	1 909	591,79	
SG ESSITY AKTIEBOLAG	SEK	71 956	11 809,60	
SG FRAPOR 1230	EUR	-38 375	-70 610,00	-0,01
SG GRAFTON 1230	GBP	-224	-18,99	
SG GRP BRUXELLES 123	EUR	-74 149	-232 827,86	-0,02
SG HARGEAVES 1230	GBP	-34 139	-77 562,33	-0,01
SG INDITEX 1230	EUR	6 750	2 386,80	
SG INFORMA SIF 1230	GBP	-62 096	-9 187,71	
SG IMMOBILIAR 1230	EUR	-160 556	-91 516,92	-0,01
SG JERONIMO 1230	EUR	-73 203	-34 405,41	
SG KARO 1230	SEK	-11 400	765,74	
SG KERRY GROUP 1230	EUR	-3 306	3 306,00	
SG KONINKLIJKE 1230	EUR	-40 287	-67 279,29	-0,01
SG KSP KINGSPAN 1230	EUR	9 456	13 209,09	
SG L OREA 1230	EUR	-22 298	-188 262,44	-0,02
SG LAGARDERE 1230	EUR	444 976	396 696,67	0,04
SG LDN DIRECT 1230	GBP	220 624	1 642,58	
SG LDN EUROPC 1230	EUR	-17 082	8 541,00	
SG LEGAL 1230	GBP	-306 493	-1 962,43	

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SG LIGHT PHIL 1230	EUR	214 038	-59 420,37	-0,01
SG LOGITECH 1230	CHF	-45 431	-21 365,53	
SG MEGGITT 1230	GBP	-51 296	1 292,98	
SG MICHAEL PA 1230	GBP	133 688	9 184,96	
SG MICHELIN 1230	EUR	41 328	250 281,86	0,02
SG MRL MERLIN 1230	EUR	-133 882	-87 023,30	-0,01
SG NEW MELROSE 1230	GBP	210 841	49 212,92	
SG NORDEA BAN 1230	EUR	-1 442	-1 195,42	
SG ODAKYU 1230	JPY	-12 484	-18 860,03	
SG ORANGE 1230	EUR	-67 660	-26 012,30	
SG PARGESA 1230	CHF	119 569	481 218,25	0,04
SG QIAGEN 1230	EUR	2 000	-3 140,00	
SG REED ELSEV (EUR)	EUR	-63 872	2 547,66	
SG REPSOL 1230	EUR	-100 378	-94 633,00	-0,01
SG RIO 1230	GBP	61 212	40 869,61	
SG ROCHE HO 1230	CHF	-67 502	-1 210 955,86	-0,11
SG ROYAL DUTC	GBP	-165 363	-181 683,96	-0,02
SG ROYAL DUTC 1230	EUR	382 180	604 405,60	0,05
SG RTL 1230	EUR	-12 703	-22 103,22	
SG SABS 1230	EUR	645 640	74 286,94	0,01
SG SAFRAN 1230	EUR	-5 158	-16 243,13	
SG SAINSBU 1230	GBP	-42 388	-11 355,22	
SG SANOFI 1230	EUR	108 246	731 911,26	0,07
SG SAP SE 1230	EUR	-148 437	96 478,50	0,01
SG SCHNEIDER 1230	EUR	-5 008	571,91	
SG SCOR 1230	EUR	13 446	21 513,60	
S_G SG GECINA 1230	EUR	-20 446		
SG SPIRAX 1230	GBP	4 210	-8 565,62	
SG SSAB 1230	SEK	-228 665	1 493,29	
SG STOXX 600 FOOD 12	EUR	-740 592	7 679 939,04	0,69
SG STRYKER 1230	USD	-2 048	8 576,44	
SG TECNICAS REUNIDAS	EUR	-61 821	14 837,04	
SG TELE2 AB 1230	SEK	-219 645	-126 525,92	-0,01
SG TERNA 1230	EUR	-70 352	-9 652,29	
SG TODS SPA CFD	EUR	-16 910	23 674,00	
SG VINCI 1230	EUR	-125 722	81 660,73	0,01
SG WACKER C 1230	EUR	-9 692	101 959,84	0,01
SG WISDOMTREE 1230	USD	-501 166	-190 775,90	-0,02
SG YIT OYJ 1230	EUR	62 207	16 484,86	

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SGX SG ESSIL 1230	EUR	-6 241	12 482,00	
SG1 SG GEBRIT 1230	CHF	-42	-1 023,82	
SG9 MAN SG 1230	EUR	4 200	-17 472,00	
SHK SG HENKEL 1230	EUR	35 957	-17 397,45	
SHM HENNES SG 1230	SEK	-20 544	328,50	
SI_ SG INGNCO 1230	EUR	-3 216	2 251,20	
SI1 SG ISS 1230	DKK	21 320	-7 567,12	
SJU SG JULIUS 1230	CHF	-16 573	-7 710,80	
SKU SG KUKA 1230	EUR	7 657	-6 125,60	
SLI SG LINDT 1230	CHF	1	41,39	
SLL SG LLOYDS 1230	GBP	-2 150 032	-78 999,39	-0,01
SM1 SG METSO 1230	EUR	11 920	-405,28	
SNO NOVART SG 1230	CHF	-33 234	75 510,97	0,01
SOX SYMRISE SG 1230	EUR	4 576	325,35	
SOZ ACKERMANS SG 123	EUR	3 136	18 236,15	
SP_ SG PEUGEO 1230	EUR	274 727	434 195,75	0,04
SPA SG PORSCHE 1230	EUR	189 707	436 263,15	0,04
SPF SG PROVID 1230	GBP	-87 515	-3 956,82	
S_Q SG QUAB I 1230	EUR	218 650	-9 839,25	
S_R SG R.D.S. 1230	GBP	134 955	190 538,52	0,02
SRB RECKIT SG 1230	GBP	-16 182	10 060,02	
S_S SG SAGE 1230	GBP	69 467	-7 223,87	
SSD SG STAN C 1230	GBP	-291 741	-189 860,99	-0,02
SSF STANDARD LIFE SG	GBP	-448 418	-185 003,47	-0,02
SSG SG SWA GR 1230	CHF	-41 427	121 944,99	0,01
SSS SG BAS 1230	EUR	-13 264	-25 948,02	
SST JAMES SOG 1230	GBP	-34 144	-5 248,76	
SSV SG SVNSKA 1230	SEK	415 816	15 340,37	
SSW SG SWATCH 1230	CHF	-8 413	3 095,58	
SS7 SG SEB 1230	EUR	-3 330	7 326,00	
STH THALES SG 1230	EUR	7 744	1 146,82	
SVA SG VALEO 1230	EUR	-13 899	-68 244,09	-0,01
SZA SG ZALNDO 1230	EUR	-47 512	158 407,88	0,01
S1A SG AGGRKO 1230	GBP	353 926	258 433,59	0,02
TELN TELENOR 1230	NOK	-73 339	23 004,94	
TL5 SG MEDIAS 1230	EUR	-1	-0,16	
UAC SG C.A. 1230	EUR	-90 071	-67 553,25	-0,01
UBS RENEWABLE 1230	NOK	60 530	-2 212,09	
UBSG UBS SG 1230	CHF	-461 723	-70 785,24	-0,01

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/09/2019 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
VIVENDI SG 1230	EUR	46 486	-1 013,65	
VOLKSWAGEN SG 1230	EUR	321 285	3 188 194,27	0,29
WOLTERS SG 1230	EUR	-6 387	-9 325,02	
TOTAL CFD			10 670 361,80	0,96
Swap de variance				
C ABS BQSK DISP 0619	EUR	10 500 000	24 074,30	
TOTAL Swap de variance			24 074,30	
TOTAL Autres instruments financiers à terme			11 291 172,42	1,01
TOTAL Instruments financiers à terme			90 259 125,24	8,04
Appel de marge				
APPEL MARGE CACEIS	SEK	451 025	42 077,15	
Appels de marges C.A.Indo en £ sterling	GBP	-31 210	-35 277,50	
Appels de marges C.A.Indo en \$ us	USD	-38 209 899,57	-35 048 522,81	-3,12
Appels de marges C.A.Indo en AUD	AUD	20 958,4	12 966,10	
Appels de marges C.A.Indo en CHF	CHF	1 265 449,53	1 164 059,91	0,10
Appels de marges C.A.Indo en euro	EUR	-37 306 003,1	-37 306 003,10	-3,32
Appels de marges C.A.Indo en yen	JPY	-826 536 321	-7 015 046,86	-0,62
TOTAL Appel de marge			-78 185 747,11	-6,96
Créances			5 426 475 650,26	483,36
Dettes			-5 172 524 808,00	-460,76
Comptes financiers			22 921 676,17	2,04
Actif net			1 122 628 217,05	100,00



H2O
Asset Management

H2O AM LLP

Limited Liability Partnership de droit anglais, agréée par la Financial Services Authority,
l'Autorité des marchés financiers du Royaume-Uni sous le numéro 529105
10 Old Burlington Street – London W1S 3AG, Grande Bretagne