

FCP de droit français

**OBJECTIF ALPHA HAUT
RENDEMENT**

PLAQUETTE SEMESTRIELLE

au 31 mars 2017

Société de Gestion : Lazard Frères Gestion SAS

Dépositaire : Caceis Bank France

Commissaire aux comptes : PriceWaterhouseCoopers Audit

- **ETAT DU PATRIMOINE EN EUR**

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Titres financiers	51 795 966,61
b) Avoirs bancaires	2 046 103,09
c) Autres actifs détenus par l'OPC	6 125 344,40
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	59 967 414,10
e) Passif	-1 222 960,34
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	58 744 453,76

* 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
OBJECTIF ALPHA HAUT RENDEMENT C	C	56 505 087,47	35 676	1 583,84
OBJECTIF ALPHA HAUT RENDEMENT D	C	2 239 366,29	2 202	1 016,96

• **ELEMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES**

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage	
	Actif net *	Total des actifs **
a) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-I du code monétaire et financier.		
b) Les titres financiers éligibles et des 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.	73,72	72,22
c) Les titres financiers éligibles et des 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.	14,45	14,15
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.		
e) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.		

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

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

• **RÉPARTITIONS DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE**

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Euro			88,17	86,37
WIND ACQU FIN 4.0% 15-07-20	EUR	1 539 686,67	2,62	2,57
ANGL AME 1.5% 01-04-20 EMTN	EUR	915 455,96	1,56	1,53
UNITYMEDIA 5.625% 04/23	EUR	872 181,00	1,48	1,45
ALTI FIN 5.25% 15-02-23 EMTN	EUR	856 190,00	1,46	1,43
SOLVAY FINANCE 5.869% PERP	EUR	829 760,63	1,41	1,38
PICARD BONDCO 7.75% 01-02-20	EUR	799 479,38	1,36	1,33
SOFT GROU 4.75% 30-07-25	EUR	781 889,11	1,33	1,30
FIAT 4.75% 03/22/2021	EUR	774 726,25	1,32	1,29
AKEFP 4 3/4 10/29/49	EUR	759 585,05	1,29	1,27
ARDA PACK FIN 6.75% 15-05-24	EUR	729 828,13	1,24	1,22
NEW AREVA HOLDING 3.25% 04-09-20	EUR	707 690,70	1,20	1,18
PETROBRAS GLOBAL FI 5.875% 07-03-	EUR	671 494,11	1,14	1,12
INTERXION HOLD 6% 07/20	EUR	662 554,17	1,13	1,10
FIAT FINA 6.75% 14-10-19 EMTN	EUR	643 279,02	1,10	1,07
MEDIFP 7% 05/15/20	EUR	642 634,67	1,09	1,07
EDF 4.25% 29/12/2049	EUR	621 089,10	1,06	1,04
TELE EURO BV 3.75% PERP	EUR	603 848,88	1,03	1,01
BELDEN 5.5% 15/04/23	EUR	537 819,72	0,92	0,90
TELE ITA 3.25% 16-01-23 EMTN	EUR	534 822,60	0,91	0,89
XPO LOGI 5.75% 15-06-21	EUR	533 549,86	0,91	0,89
CNH INDU 6.25% 09-03-18 EMTN	EUR	530 006,03	0,90	0,88
AIR FRANCE-KLM 6.25% 18/01/2018	EUR	529 761,85	0,90	0,88
NUME GROU 5.375% 15-05-22	EUR	525 862,99	0,90	0,88
UNITYMEDIA 4.0% 15-01-25	EUR	525 548,89	0,89	0,88
MATTERHORN TELECOM 4.875% 01-	EUR	511 549,38	0,87	0,85
REPSOL SA 4.5% 25-03-75	EUR	507 546,44	0,86	0,85
CASINO GUICHARD PERRACHON	EUR	492 592,88	0,84	0,82
ALTI LUXE SA 7.25% 15-05-22	EUR	481 193,13	0,82	0,80
TOT 3.369% PERP EMTN	EUR	473 226,20	0,81	0,79
BUZZI UNICEM SPA 6.25% 28/09/2018	EUR	448 872,71	0,76	0,75
THE CHEM COMP 6.125% 15-05-23	EUR	438 719,72	0,75	0,73
THOMAS COOK GROUP 6.25% 15-06-	EUR	438 323,56	0,75	0,73
HORI HOLD I S 7.25% 01-08-23	EUR	430 991,00	0,73	0,72
TRIONISTA TOPCO GMBH 6.875%	EUR	428 719,89	0,73	0,71
HOMEVI 6.875% 15-08-21	EUR	424 419,06	0,72	0,71
ACCOR SA 4.125% PERP	EUR	424 139,12	0,72	0,71
TELEFONICA EUROPE 5% 12/99	EUR	423 643,18	0,72	0,71
RAPI HOLD GMB 6.625% 15-11-20	EUR	423 143,94	0,72	0,71
THOM EUROPE 7.375% 15-07-19	EUR	421 361,61	0,72	0,70
PETROBRAS INTL FIN CO	EUR	420 613,86	0,72	0,70
NEW AREVA HOLDING 4.375% 06-11-	EUR	417 651,84	0,71	0,70
CONS NV 7.0% 15-01-23	EUR	416 876,44	0,71	0,70
TA MFG LIM 3.625% 15-04-23	EUR	413 682,94	0,70	0,69
VOTO CIME 3.5% 13-07-22	EUR	412 160,38	0,70	0,69
LOXAM 4.25% 15-04-24	EUR	406 904,00	0,69	0,68
ADIE GLOB HOL 3.5% 15-08-24	EUR	405 377,56	0,69	0,68
GAS NATU FENOSA 3.375% 29-12-99	EUR	403 364,27	0,69	0,67
SELE GROU BV 6.5% 15-06-20	EUR	400 156,22	0,68	0,67
HEMABV 6 1/4 06/15/19	EUR	399 709,44	0,68	0,67

• **RÉPARTITIONS DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE**

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
TDC AS 3.5% 26-02-15	EUR	399 199,18	0,68	0,67
ATALIAN 7.25% 01/20	EUR	397 586,15	0,68	0,66
BISOHO SAS 5.875% 01-05-23	EUR	384 852,56	0,66	0,64
VRX ESCR CORP 4.5% 15-05-23	EUR	377 477,50	0,64	0,63
CASINO 4.726% STEP-UP 26-05-21	EUR	366 370,87	0,62	0,61
LABERE 5 5/8 03/15/21	EUR	361 577,56	0,62	0,60
KERLING 6.25% 15-05-21	EUR	351 296,38	0,60	0,59
PETROLEOS MEXICANOS 3.75% 21-02-	EUR	337 594,97	0,57	0,56
CASINO GUICHARD PERRACHON	EUR	335 196,65	0,57	0,56
OLIVETTI 7.75% 01/33	EUR	334 418,25	0,57	0,56
TELEFONICA EUROPE BV 6.5% 29/09/49	EUR	332 370,08	0,57	0,55
NHHSM 6 7/8 11/15/19	EUR	331 054,54	0,56	0,55
EURO SCIE 4.875% PERP	EUR	330 276,29	0,56	0,55
ENEL SPA TF/TV 01/10/74	EUR	328 679,67	0,56	0,55
EDRE ODIG SA 8.5% 01-08-21	EUR	328 531,50	0,56	0,55
ORIGIN ENERGY FINANCE LT TF/TV	EUR	326 757,52	0,56	0,54
ALBEA BEAUTY HOLDINGS SA 8.75%	EUR	325 880,25	0,55	0,54
ALLGRP 6 1/4 12/01/21	EUR	325 069,25	0,55	0,54
SCHO ALLI GRO 8.0% 01-10-21	EUR	323 327,00	0,55	0,54
FAENZA 8.25% 08/21	EUR	323 138,75	0,55	0,54
MTNA 2 7/8 07/06/20	EUR	322 363,40	0,55	0,54
CEME FINA LLC 4.625% 15-06-24	EUR	322 309,04	0,55	0,54
KLOC PENT OF 7.125% 01-11-20	EUR	321 084,38	0,55	0,54
TELECOM ITALIA SPA EX OLIVETTI	EUR	320 927,59	0,55	0,54
NAVI A E3R+6.5% 31-07-23	EUR	320 770,67	0,55	0,53
HAPAG LLOYD 6.75% 01-02-22	EUR	320 595,75	0,55	0,53
VWR FUND INC 4.625% 15-04-22	EUR	319 056,54	0,54	0,53
SOCI EURO DES SAT 4.625% PERP	EUR	317 660,26	0,54	0,53
DUFR FIN 4.5% 15-07-22 EMTN	EUR	316 561,50	0,54	0,53
TEREOS 4.125% 16-06-23	EUR	316 338,00	0,54	0,53
PVH EX PHIL V 3.625% 15-07-24	EUR	314 455,46	0,54	0,52
OVAKO GROUP AB 6.5% 01/06/2019	EUR	312 215,50	0,53	0,52
KERNEOS 5 3/4 03/01/21	EUR	312 081,25	0,53	0,52
RAIN CII 8.5% 15/01/2021	EUR	311 812,50	0,53	0,52
MERLIN ENTERTAINMENTS 2.75% 15-	EUR	310 620,42	0,53	0,52
HANE FINA LUX 3.5% 15-06-24	EUR	310 589,17	0,53	0,52
MANTEN 8 1/2 08/01/20	EUR	307 393,50	0,52	0,51
MATTERHORN TELECOM HLD 4.875%	EUR	307 040,63	0,52	0,51
BOPA FIN 4.375% 15-07-21 EMTN	EUR	301 243,46	0,51	0,50
MONI HOLD 2 S 6.875% 15-06-22	EUR	300 001,79	0,51	0,50
MOBILUX FINANCE SAS 5.5% 15-11-24	EUR	287 589,50	0,49	0,48
EPHI HOLD II 8.25% 01-07-23	EUR	281 480,63	0,48	0,47
ORANGE 5.25% PERP	EUR	277 701,20	0,47	0,46
ALTI LUXE SA 6.25% 15-02-25	EUR	266 932,71	0,45	0,45
LOCK AS 7.0% 15-08-21	EUR	266 601,94	0,45	0,44
LECTA 6.5% 01-08-23	EUR	264 838,75	0,45	0,44
PAPREC 5.25% 01-04-22	EUR	261 686,88	0,45	0,44
CMA CGM SA 7.75% 15-01-21	EUR	257 286,74	0,44	0,43
UNITYMEDIA 5.5% 15/09/2022	EUR	254 616,08	0,43	0,42
NEWCO SAB MIDCO SASU 5.375% 15-	EUR	250 937,50	0,43	0,42

• **RÉPARTITIONS DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE**

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
IMS HEALTH 3.25% 15-03-25	EUR	249 930,00	0,43	0,42
MAGY OLAJ GAZ 2.625% 28-04-23	EUR	248 117,97	0,42	0,41
QUICK E3R+ 4.75% 15/04/2019	EUR	242 131,17	0,41	0,40
HP PELZER 4.125% 01-04-24	EUR	226 858,50	0,39	0,38
KIRK BEAU ZER 8.75% 15-07-23	EUR	224 436,28	0,38	0,37
HEID DRUC AG 8.0% 15-05-22	EUR	222 881,78	0,38	0,37
AURI LUXE II 8.0% 15-01-23	EUR	220 659,11	0,38	0,37
GRUP EMPR ENC 5.375% 01-11-22	EUR	219 692,75	0,37	0,37
TELEFO 5 7/8 12/31/49	EUR	219 276,77	0,37	0,37
SILK BIDCO 7.5% 01-02-22	EUR	218 101,00	0,37	0,36
SOCIETE EUROPEENNE DES	EUR	217 329,42	0,37	0,36
TELE FINA VI 4.875% 15-07-27	EUR	217 233,58	0,37	0,36
LOXAM 7.0% 23-07-22	EUR	217 186,89	0,37	0,36
NW GLOBAL VENDING SPA 7.0% 15-	EUR	216 559,11	0,37	0,36
ENER DE PORT 5.375% 16-09-75	EUR	216 247,59	0,37	0,36
ORAN 4.0% PERP EMTN	EUR	215 148,79	0,37	0,36
ADRBID 7 7/8 11/15/20	EUR	214 921,25	0,37	0,36
CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC	EUR	214 806,72	0,37	0,36
PAPREC HOLDING 7.375% 01-04-23	EUR	213 420,92	0,36	0,36
FIAT FINANCE TRADE 6.625%	EUR	212 388,03	0,36	0,35
UPC HOLDING BV	EUR	211 332,92	0,36	0,35
GAS NATU FENO 4.125% 30-11-49	EUR	211 304,58	0,36	0,35
NEW AREVA HOLDING 4.875% 23-09-	EUR	209 355,48	0,36	0,35
IMS HEALTH 3.5% 15-10-24	EUR	208 370,67	0,35	0,35
SGL 4 7/8 01/15/21	EUR	207 959,58	0,35	0,35
3AB OPTIQUE DEVELOPPEM 5.625%	EUR	207 699,25	0,35	0,35
MCS GR E3R+5.75% 30-09-21	EUR	206 090,44	0,35	0,34
ORIG ENER LTD VAR 16-09-74	EUR	203 702,60	0,35	0,34
OI EUROPEAN GROUP BV 3.125% 15-	EUR	202 753,53	0,35	0,34
IGLO F E3R+4.5% 15-06-20	EUR	202 361,33	0,34	0,34
NYRSTAR NETHERLANDS HOLDINGS	EUR	201 656,67	0,34	0,34
NOVAFIVES 4.5% 30-06-21	EUR	200 821,00	0,34	0,33
VIRG MED 4.5% 15-01-25 EMTN	EUR	183 024,63	0,31	0,31
UPC HOLDING 6.75% 03/23	EUR	162 726,38	0,28	0,27
TITIM 2 1/2 07/19/23	EUR	152 635,05	0,26	0,25
ARAMARK INTERNATIONAL FINANCE	EUR	151 999,15	0,26	0,25
SCHMOLZ+BICKENBACH LUX 9.875%	EUR	141 289,51	0,24	0,24
TRIN MATE OPE 6.375% 01-05-22	EUR	109 706,38	0,19	0,18
INEOS GROUP 5.375% 01-08-24	EUR	104 718,63	0,18	0,17
SOUS-TOTAL EUR		51 795 966,61		

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

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

• **RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR**

Pays	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
France	23,72	23,24
Luxembourg	18,52	18,14
Pays-bas	10,32	10,11
Allemagne	6,86	6,72
Etats unis americque	6,61	6,47
Royaume uni	6,52	6,38
Italie	3,41	3,34
Espagne	2,35	2,30
Japon	1,33	1,30
Irlande	1,24	1,22
Australie	0,90	0,88
Norvege	0,83	0,81
Iles caimans	0,72	0,70
Bresil	0,70	0,69
Jersey	0,69	0,68
Danemark	0,68	0,67
Canada	0,64	0,63
Mexique	0,57	0,56
Suede	0,53	0,52
Hongrie	0,42	0,41
Portugal	0,37	0,36
Suisse	0,24	0,24
TOTAL	88,17	86,37
AUTRES ACTIFS DETENUS (b+c de l'état du patrimoine)		13,63
TOTAL DES ACTIFS		100,00
AUTRES ACTIFS DETENUS (b+c+e de l'état du patrimoine)	11,83	
TOTAL ACTIF NET	100,00	

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

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

• **VENTILATION DES AUTRES ACTIFS PAR NATURE ***

Nature d'actifs	Pourcentage actif net **	Pourcentage total des actifs ***
Titres de créances		
Négociés sur un marché réglementé ou assimilé		
Titres de créances négociables		
Autres titres de créances		
Non négociés sur un marché réglementé ou assimilé		
Organismes de placement collectif	9,51	9,31
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	9,51	9,31
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE		
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés		
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés		
Autres organismes non européens		
Autres		
TOTAL	9,51	9,31

* Cette rubrique concerne des titres financiers éligibles ou des instruments du marché monétaire ne répondant pas aux conditions mentionnées au I de l'article R.214-11 du Code monétaire et financier

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

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

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

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
a) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-I du code monétaire et financier.		
b) Les titres financiers éligibles et des 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.	22 000 497,29	23 798 974,46
c) Les titres financiers éligibles et des 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.	5 748 015,44	4 860 472,61
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.		
e) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.		

• **DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE**

	Part	Montant net unitaire €	Crédit d'impôt (1) €	Montant brut unitaire (2) €
Dividendes versés				
28/11/2016	OBJECTIF ALPHA HAUT RENDEMENT D	43,41		43,41
Dividendes à verser				
	OBJECTIF ALPHA HAUT RENDEMENT D			

(1) Le crédit d'impôt unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

(2) Le montant brut unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

• **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 :
Lazard Frères Gestion SAS - 25 rue de Courcelles - 75008 - Paris

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

Au cours de l'exercice, l'OPC n'a pas fait l'objet d'opérations relevant de la réglementation SFTR.

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 31/03/2017 EN EUR**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
FAENZA 8.25% 08/21	EUR	300 000	323 138,75	0,55
HAPAG LLOYD 6.75% 01-02-22	EUR	300 000	320 595,75	0,55
HEID DRUC AG 8.0% 15-05-22	EUR	200 000	222 881,78	0,38
HP PELZER 4.125% 01-04-24	EUR	225 000	226 858,50	0,39
KIRK BEAU ZER 8.75% 15-07-23	EUR	200 000	224 436,28	0,38
RAPI HOLD GMB 6.625% 15-11-20	EUR	400 000	423 143,94	0,72
SGL 4 7/8 01/15/21	EUR	200 000	207 959,58	0,35
TRIONISTA TOPCO GMBH 6.875% 30/04/2021	EUR	400 000	428 719,89	0,73
UNITYMEDIA 4.0% 15-01-25	EUR	500 000	525 548,89	0,89
UNITYMEDIA 5.5% 15/09/2022	EUR	300 000	254 616,08	0,43
UNITYMEDIA 5.625% 04/23	EUR	1 000 000	872 181,00	1,49
TOTAL ALLEMAGNE			4 030 080,44	6,86
AUSTRALIE				
ORIG ENER LTD VAR 16-09-74	EUR	200 000	203 702,60	0,35
ORIGIN ENERGY FINANCE LT TF/TV 16/06/2071	EUR	300 000	326 757,52	0,55
TOTAL AUSTRALIE			530 460,12	0,90
BRESIL				
VOTO CIME 3.5% 13-07-22	EUR	400 000	412 160,38	0,70
TOTAL BRESIL			412 160,38	0,70
CANADA				
VRX ESCR CORP 4.5% 15-05-23	EUR	500 000	377 477,50	0,64
TOTAL CANADA			377 477,50	0,64
DANEMARK				
TDC AS 3.5% 26-02-15	EUR	400 000	399 199,18	0,68
TOTAL DANEMARK			399 199,18	0,68
ESPAGNE				
GRUP EMPR ENC 5.375% 01-11-22	EUR	200 000	219 692,75	0,37
NAVI A E3R+6.5% 31-07-23	EUR	300 000	320 770,67	0,55
NHHSM 6 7/8 11/15/19	EUR	300 000	331 054,54	0,56
REPSOL SA 4.5% 25-03-75	EUR	500 000	507 546,44	0,87
TOTAL ESPAGNE			1 379 064,40	2,35
ETATS UNIS AMERIQUE				
BELDEN 5.5% 15/04/23	EUR	500 000	537 819,72	0,91
CATALENT PHARMA SOLUTIONS INC 4.75% 15-12-24	EUR	200 000	214 806,72	0,37
CEME FINA LLC 4.625% 15-06-24	EUR	300 000	322 309,04	0,55

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 31/03/2017 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
IMS HEALTH 3.25% 15-03-25	EUR	250 000	249 930,00	0,43
IMS HEALTH 3.5% 15-10-24	EUR	200 000	208 370,67	0,35
KLOC PENT OF 7.125% 01-11-20	EUR	300 000	321 084,38	0,55
PVH EX PHIL V 3.625% 15-07-24	EUR	300 000	314 455,46	0,54
RAIN CII 8.5% 15/01/2021	EUR	300 000	311 812,50	0,53
THE CHEM COMP 6.125% 15-05-23	EUR	400 000	438 719,72	0,75
TRIN MATE OPE 6.375% 01-05-22	EUR	100 000	109 706,38	0,19
VWR FUND INC 4.625% 15-04-22	EUR	300 000	319 056,54	0,54
XPO LOGI 5.75% 15-06-21	EUR	500 000	533 549,86	0,90
TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE			3 881 620,99	6,61
FRANCE				
ACCOR SA 4.125% PERP	EUR	400 000	424 139,12	0,72
AIR FRANCE-KLM 6.25% 18/01/2018	EUR	500 000	529 761,85	0,90
AKEFP 4 3/4 10/29/49	EUR	700 000	759 585,05	1,29
ATALIAN 7.25% 01/20	EUR	375 000	397 586,15	0,68
BISOHO SAS 5.875% 01-05-23	EUR	350 000	384 852,56	0,66
CASINO GUICHARD PERRACHON 4.561% 25-01-23	EUR	300 000	335 196,65	0,57
CASINO GUICHARD PERRACHON 4.87% PERP	EUR	500 000	492 592,88	0,84
CASINO 4.726% STEP-UP 26-05-21 EMTN	EUR	300 000	366 370,87	0,62
CMA CGM SA 7.75% 15-01-21	EUR	250 000	257 286,74	0,44
EDF 4.25% 29/12/2049	EUR	600 000	621 089,10	1,06
HOMEVI 6.875% 15-08-21	EUR	400 000	424 419,06	0,72
HORI HOLD I S 7.25% 01-08-23	EUR	400 000	430 991,00	0,73
KERNEOS 5 3/4 03/01/21	EUR	300 000	312 081,25	0,53
LABERE 5 5/8 03/15/21	EUR	350 000	361 577,56	0,62
LOXAM 4.25% 15-04-24	EUR	400 000	406 904,00	0,69
LOXAM 7.0% 23-07-22	EUR	200 000	217 186,89	0,37
MANTEN 8 1/2 08/01/20	EUR	300 000	307 393,50	0,52
MCS GR E3R+5.75% 30-09-21	EUR	200 000	206 090,44	0,35
MEDIFP 7% 05/15/20	EUR	600 000	642 634,67	1,09
MOBILUX FINANCE SAS 5.5% 15-11-24	EUR	275 000	287 589,50	0,49
NEW AREVA HOLDING 3.25% 04-09-20	EUR	700 000	707 690,70	1,20
NEW AREVA HOLDING 4.375% 06-11-19	EUR	400 000	417 651,84	0,71
NEW AREVA HOLDING 4.875% 23-09-24	EUR	200 000	209 355,48	0,36
NEWCO SAB MIDCO SASU 5.375% 15-04-25	EUR	250 000	250 937,50	0,43
NOVAFIVES 4.5% 30-06-21	EUR	200 000	200 821,00	0,34
NUME GROU 5.375% 15-05-22	EUR	500 000	525 862,99	0,90
ORAN 4.0% PERP EMTN	EUR	200 000	215 148,79	0,37
ORANGE 5.25% PERP	EUR	250 000	277 701,20	0,47

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 31/03/2017 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
PAPREC HOLDING 7.375% 01-04-23	EUR	200 000	213 420,92	0,36
PAPREC 5.25% 01-04-22	EUR	250 000	261 686,88	0,45
QUICK E3R+ 4.75% 15/04/2019	EUR	300 000	242 131,17	0,41
SOLVAY FINANCE 5.869% PERP	EUR	700 000	829 760,63	1,41
TEREOS 4.125% 16-06-23	EUR	300 000	316 338,00	0,54
THOM EUROPE 7.375% 15-07-19	EUR	400 000	421 361,61	0,72
TOT 3.369% PERP EMTN	EUR	470 000	473 226,20	0,81
3AB OPTIQUE DEVELOPPEM 5.625% 15/04/2019	EUR	200 000	207 699,25	0,35
TOTAL FRANCE			13 936 123,00	23,72
HONGRIE				
MAGY OLAJ GAZ 2.625% 28-04-23	EUR	233 000	248 117,97	0,42
TOTAL HONGRIE			248 117,97	0,42
ILES CAIMANS				
PETROBRAS INTL FIN CO	EUR	400 000	420 613,86	0,72
TOTAL ILES CAIMANS			420 613,86	0,72
IRLANDE				
ARDA PACK FIN 6.75% 15-05-24	EUR	650 000	729 828,13	1,24
TOTAL IRLANDE			729 828,13	1,24
ITALIE				
BUZZI UNICEM SPA 6.25% 28/09/2018	EUR	400 000	448 872,71	0,76
ENEL SPA TF/TV 01/10/74	EUR	300 000	328 679,67	0,56
NWV GLOBAL VENDING SPA 7.0% 15-10-23	EUR	200 000	216 559,11	0,37
TELE ITA 3.25% 16-01-23 EMTN	EUR	500 000	534 822,60	0,91
TELECOM ITALIA SPA EX OLIVETTI 3.625% 19-01-24	EUR	300 000	320 927,59	0,55
TITIM 2 1/2 07/19/23	EUR	150 000	152 635,05	0,26
TOTAL ITALIE			2 002 496,73	3,41
JAPON				
SOFT GROU 4.75% 30-07-25	EUR	700 000	781 889,11	1,33
TOTAL JAPON			781 889,11	1,33
JERSEY				
ADIE GLOB HOL 3.5% 15-08-24	EUR	400 000	405 377,56	0,69
TOTAL JERSEY			405 377,56	0,69
LUXEMBOURG				
ALBEA BEAUTY HOLDINGS SA 8.75% 11/19	EUR	300 000	325 880,25	0,55
ALTI FIN 5.25% 15-02-23 EMTN	EUR	800 000	856 190,00	1,46
ALTI LUXE SA 6.25% 15-02-25	EUR	250 000	266 932,71	0,45
ALTI LUXE SA 7.25% 15-05-22	EUR	450 000	481 193,13	0,82
ARAMARK INTERNATIONAL FINANCE SARL 3.125% 01-04-25	EUR	150 000	151 999,15	0,26
AURI LUXE II 8.0% 15-01-23	EUR	200 000	220 659,11	0,38

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 31/03/2017 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CNH INDU 6.25% 09-03-18 EMTN	EUR	500 000	530 006,03	0,90
DUFR FIN 4.5% 15-07-22 EMTN	EUR	300 000	316 561,50	0,54
EDRE ODIG SA 8.5% 01-08-21	EUR	300 000	328 531,50	0,56
EURO SCIE 4.875% PERP	EUR	300 000	330 276,29	0,56
FIAT FINA 6.75% 14-10-19 EMTN	EUR	550 000	643 279,02	1,10
FIAT FINANCE TRADE 6.625% 15/03/2018	EUR	200 000	212 388,03	0,36
FIAT 4.75% 03/22/2021	EUR	700 000	774 726,25	1,32
HANE FINA LUX 3.5% 15-06-24	EUR	300 000	310 589,17	0,53
LECTA 6.5% 01-08-23	EUR	250 000	264 838,75	0,45
MATTERHORN TELECOM HLD 4.875% 01/05/23	EUR	300 000	307 040,63	0,52
MATTERHORN TELECOM 4.875% 01-05-23	EUR	500 000	511 549,38	0,87
MONI HOLD 2 S 6.875% 15-06-22	EUR	300 000	300 001,79	0,51
MTNA 2 7/8 07/06/20	EUR	300 000	322 363,40	0,55
OLIVETTI 7.75% 01/33	EUR	250 000	334 418,25	0,57
PICARD BONDCO 7.75% 01-02-20	EUR	750 000	799 479,38	1,36
SOCI EURO DES SAT 4.625% PERP	EUR	300 000	317 660,26	0,54
SOCIETE EUROPEENNE DES SATELLITES SA 5.625% PERP	EUR	200 000	217 329,42	0,37
TELE FINA VI 4.875% 15-07-27	EUR	200 000	217 233,58	0,37
WIND ACQU FIN 4.0% 15-07-20	EUR	1 500 000	1 539 686,67	2,62
TOTAL LUXEMBOURG			10 880 813,65	18,52
MEXIQUE				
PETROLEOS MEXICANOS 3.75% 21-02-24	EUR	330 000	337 594,97	0,57
TOTAL MEXIQUE			337 594,97	0,57
NORVEGE				
LOCK AS 7.0% 15-08-21	EUR	250 000	266 601,94	0,46
SILK BIDCO 7.5% 01-02-22	EUR	200 000	218 101,00	0,37
TOTAL NORVEGE			484 702,94	0,83
PAYS-BAS				
ADRBID 7 7/8 11/15/20	EUR	200 000	214 921,25	0,37
CONS NV 7.0% 15-01-23	EUR	400 000	416 876,44	0,71
GAS NATU FENO 4.125% 30-11-49	EUR	200 000	211 304,58	0,36
GAS NATU FENOSA 3.375% 29-12-99	EUR	400 000	403 364,27	0,69
HEMABV 6 1/4 06/15/19	EUR	400 000	399 709,44	0,68
INTERXION HOLD 6% 07/20	EUR	625 000	662 554,17	1,13
NYRSTAR NETHERLANDS HOLDINGS BV 6.875% 15-03-24	EUR	200 000	201 656,67	0,34
OI EUROPEAN GROUP BV 3.125% 15-11-24	EUR	200 000	202 753,53	0,35
PETROBRAS GLOBAL FI 5.875% 07-03-22 EMTN	EUR	600 000	671 494,11	1,13
SCHO ALLI GRO 8.0% 01-10-21	EUR	300 000	323 327,00	0,55
SELE GROU BV 6.5% 15-06-20	EUR	400 000	400 156,22	0,68

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 31/03/2017 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TELE EURO BV 3.75% PERP	EUR	600 000	603 848,88	1,03
TELEFO 5 7/8 12/31/49	EUR	200 000	219 276,77	0,37
TELEFONICA EUROPE BV 6.5% 29/09/49	EUR	300 000	332 370,08	0,57
TELEFONICA EUROPE 5% 12/99	EUR	400 000	423 643,18	0,72
UPC HOLDING BV	EUR	200 000	211 332,92	0,36
UPC HOLDING 6.75% 03/23	EUR	150 000	162 726,38	0,28
TOTAL PAYS-BAS			6 061 315,89	10,32
PORTUGAL				
ENER DE PORT 5.375% 16-09-75	EUR	200 000	216 247,59	0,37
TOTAL PORTUGAL			216 247,59	0,37
ROYAUME UNI				
ALLGRP 6 1/4 12/01/21	EUR	300 000	325 069,25	0,55
ANGL AME 1.5% 01-04-20 EMTN	EUR	900 000	915 455,96	1,57
BOPA FIN 4.375% 15-07-21 EMTN	EUR	300 000	301 243,46	0,51
EPHI HOLD II 8.25% 01-07-23	EUR	250 000	281 480,63	0,48
IGLO F E3R+4.5% 15-06-20	EUR	200 000	202 361,33	0,34
INEOS GROUP 5.375% 01-08-24	EUR	100 000	104 718,63	0,18
KERLING 6.25% 15-05-21	EUR	325 000	351 296,38	0,60
MERLIN ENTERTAINMENTS 2.75% 15-03-22	EUR	300 000	310 620,42	0,53
TA MFG LIM1 3.625% 15-04-23	EUR	400 000	413 682,94	0,70
THOMAS COOK GROUP 6.25% 15-06-22	EUR	400 000	438 323,56	0,75
VIRG MED 4.5% 15-01-25 EMTN	EUR	175 000	183 024,63	0,31
TOTAL ROYAUME UNI			3 827 277,19	6,52
SUEDE				
OVAKO GROUP AB 6.5% 01/06/2019	EUR	300 000	312 215,50	0,53
TOTAL SUEDE			312 215,50	0,53
SUISSE				
SCHMOLZ+BICKENBACH LUX 9.875% 15/05/2019	EUR	200 000	141 289,51	0,24
TOTAL SUISSE			141 289,51	0,24
TOTAL Obligations & val. ass. ng. sur mar. régl. ou ass.			51 795 966,61	88,17
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			51 795 966,61	88,17
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
OBJECTIF MONET.EURO B FCP 3DEC	EUR	5,4	5 585 490,11	9,51
TOTAL FRANCE			5 585 490,11	9,51
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			5 585 490,11	9,51
TOTAL Organismes de placement collectif			5 585 490,11	9,51

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 31/03/2017 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Créances			539 854,29	0,92
Dettes			-1 222 960,34	-2,08
Comptes financiers			2 046 103,09	3,48
Actif net			58 744 453,76	100,00

Stock : Stock admi principal au 31/03/17

PORTEFUEUILLE : 106004 OBJECTIF ALPHA HAUT RENDEMENT

VL VALIDEE

Devise de fixing : FXR Cours REUTERS

Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : NPC - TYPE D'INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR, Tris

V A L E U R	STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P.R.U EN DEVISE	DATE	COURS	I	<----->	Devise du portefeuille	----->	PRCT
	VAL/LIGNE		EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR. COURS	COTA	VALEUR	F	PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL ACT NET

I - Obligations & Valeurs assimilées

Obligations & valeurs assimilées négociés sur un marché réglementé

Obligations à taux fixe négo. sur un marché regl.

Devise de valeur EUR EURO

DE000A14J7A9	HEID DRU 8.0 05-22	(USA)	150522	200,000.	M EUR	103.1333	% 31/03/17	108.352	4	206,266.67	222,881.78	6,177.78	16,615.11	0.38
DE000A1G4PS9	SCHMOLZ 9.875% 19	(USA)	150519	200,000.	M EUR	106.9201	% 31/03/17	104.45	4	139,537.20	141,289.51	4,975.99	1,752.31	0.24
FR0010804500	NEW ARE 4.875 09-24	(366)	230924	200,000.	M EUR	106.2595	% 31/03/17	102.1	4	212,519.04	209,355.48	5,155.48	-3,163.56	0.36
FR0010817452	NEW ARE 4.375 11-19	(366)	061119	400,000.	M EUR	105.4358	% 31/03/17	102.627	4	421,743.02	417,651.84	7,143.84	-4,091.18	0.71
FR0011374099	AIR FRANCE 6.25% 18	(366)	180118	500,000.	M EUR	109.4964	% 31/03/17	104.651	4	547,482.14	529,761.85	6,506.85	-17,720.29	0.90
FR0011400571	CASI GU 4.561 01-23	(366)	250123	300,000.	M EUR	102.7762	% 31/03/17	110.87	4	308,328.53	335,196.65	2,586.65	26,868.12	0.57
FR0011401736	EDF 4.25% 12/49	(366)	311299	600,000.	M EUR	103.5104	% 31/03/17	102.758	4	621,062.14	621,089.10	4,541.10	26.96	1.06
FR0011560986	NEW ARE 3.25 09-20	(366)	040920	700,000.	M EUR	93.9434	% 31/03/17	99.211	4	657,604.04	707,690.70	13,213.70	50,086.66	1.20
FR0011606169	CASINO 4.87 PERP	(EXA)	311299	500,000.	M EUR	97.7133	% 31/03/17	97.678	4	488,566.27	492,592.88	4,202.88	4,026.61	0.84
FR0012005924	ACCOR SA 4.13 PERP	(366)	311299	400,000.	M EUR	104.9701	% 31/03/17	102.893	4	419,880.30	424,139.12	12,567.12	4,258.82	0.72
FR0012278539	AKEFP 4 3/4 10/29/49	(EXA)	311299	700,000.	M EUR	104.7246	% 31/03/17	106.469	4	733,072.31	759,585.05	14,302.05	26,512.74	1.29
FR0013183571	TEREOS 4.13 06-23	(366)	160623	300,000.	M EUR	100.494	% 31/03/17	102.146	4	301,481.85	316,338.00	9,900.00	14,856.15	0.54
PTEDPUOM0024	ENER DE 5.38 09-75	(366)	160975	200,000.	M EUR	100.2064	% 31/03/17	107.844	4	200,412.69	216,247.59	559.59	15,834.90	0.37
XS0161100515	OLIVETTI 7.75% 01/33	(366)	240133	250,000.	M EUR	148.833	% 31/03/17	132.281	4	372,082.61	334,418.25	3,715.75	-37,664.36	0.57
XS0604641034	CNH INDUS FIX 090318	(366)	090318	500,000.	M EUR	111.3269	% 31/03/17	105.556	4	556,634.46	530,006.03	2,226.03	-26,628.43	0.90
XS0615236774	ORIGIN ENER. TF/TV	(UST)	160671	300,000.	M EUR	105.8829	% 31/03/17	106.561	4	317,648.73	326,757.52	7,074.52	9,108.79	0.56
XS0716979595	PETROBRAS 5.875 0322	(366)	070322	600,000.	M EUR	103.0474	% 31/03/17	111.465	4	618,284.33	671,494.11	2,704.11	53,209.78	1.14
XS0783934168	ALBEA 8.75% 11/19	(USA)	011119	300,000.	M EUR	110.7778	% 31/03/17	104.908	4	332,333.34	325,880.25	11,156.25	-6,453.09	0.55
XS0808635352	MANTEN 8 1/2 08/01/2	(EUR)	010820	300,000.	M EUR	104.9454	% 31/03/17	100.977	4	314,836.11	307,393.50	4,462.50	-7,442.61	0.52
XS0827991760	UNITYMEDIA 5.5% 2022	(USA)	150922	300,000.	M EUR	121.0686	% 31/03/17	104.49	4	294,196.79	254,616.08	705.38	-39,580.71	0.43
XS0832993397	UPC HOLDING BV	(EUR)	150922	200,000.	M EUR	111.0568	% 31/03/17	105.33	4	222,113.55	211,332.92	672.92	-10,780.63	0.36
XS0835273235	BUZZI 6.25% 28/09/18	(366)	280918	400,000.	M EUR	103.1217	% 31/03/17	108.999	4	412,486.94	448,872.71	12,876.71	36,385.77	0.76
XS0835890350	PETROBRAS INTL FIN C	(EXA)	021023	400,000.	M EUR	103.2656	% 31/03/17	103.011	4	413,062.33	420,613.86	8,569.86	7,551.53	0.72
XS0867945197	RAIN CII 8.5% 01/21	(EUR)	030417	300,000.	M EUR	101.7907	% 31/03/17	103.9375	R	305,372.22	311,812.50	0.00	6,440.28	0.53
XS0873629223	ATALIAN 7.25% 01/20	(EUR)	150120	375,000.	M EUR	108.4523	% 31/03/17	104.432	4	406,696.18	397,586.15	5,966.15	-9,110.03	0.68
XS0903269370	BELDEN 5.5 04/23	(USA)	150423	500,000.	M EUR	104.5801	% 31/03/17	104.982	4	522,900.36	537,819.72	12,909.72	14,919.36	0.92
XS0906420574	FIAT 6.625% 15/03/18	(EXA)	150318	200,000.	M EUR	112.3434	% 31/03/17	105.831	4	224,686.85	212,388.03	726.03	-12,298.82	0.36
XS0909769407	UPC HOLD 6.75% 03/23	(USA)	150323	150,000.	M EUR	107.0693	% 31/03/17	108.128	4	160,603.93	162,726.38	534.38	2,122.45	0.28
XS0918739318	UNITYMEDIA 5.625% 23	(USA)	150423	1,000,000.	M EUR	124.1927	% 31/03/17	106.382	4	993,541.67	872,181.00	21,125.00	-121,360.67	1.48
XS0924046682	MEDIFP 7% 05/15/20	(USA)	150520	600,000.	M EUR	106.3694	% 31/03/17	104.403	4	638,216.66	642,634.67	16,216.67	4,418.01	1.09
XS0929660974	TRIONISTA 6.875% 21	(USA)	300421	400,000.	M EUR	108.0408	% 31/03/17	104.239	4	432,163.19	428,719.89	11,763.89	-3,443.30	0.73
XS0946728564	INTERXION 6% 07/20	(360)	150720	625,000.	M EUR	106.798	% 31/03/17	104.692	4	667,487.49	662,554.17	8,229.17	-4,933.32	1.13
XS0953215349	FIAT 6 3/4 10/14/19	(366)	141019	550,000.	M EUR	102.7822	% 31/03/17	113.779	4	565,302.29	643,279.02	17,494.52	77,976.73	1.10
XS0954675129	ENEL TF/TV 01/10/74	(EXA)	100174	300,000.	M EUR	112.6039	% 31/03/17	108.064	4	337,811.62	328,679.67	4,487.67	-9,131.95	0.56
XS0954676283	NHHSM 6 7/8 11/15/19	(EUR)	151119	300,000.	M EUR	112.3472	% 31/03/17	107.697	4	337,041.67	331,054.54	7,963.54	-5,987.13	0.56
XS0955817738	FAENZA 8.25% 08/21	(EUR)	150821	300,000.	M EUR	106.8354	% 31/03/17	106.59	4	320,506.25	323,138.75	3,368.75	2,632.50	0.55
XS0972570351	TELEFO 6.5% 09/49	(EXA)	311299	300,000.	M EUR	113.076	% 31/03/17	107.264	4	339,228.08	332,370.08	10,578.08	-6,858.00	0.57
XS0992294388	ADRBID 7 7/8 11/15/2	(EUR)	151120	200,000.	M EUR	107.1938	% 31/03/17	104.42	4	214,387.50	214,921.25	6,081.25	533.75	0.37
XS1002933403	SGL 4 7/8 01/15/21	(EUR)	150121	200,000.	M EUR	101.2906	% 31/03/17	102.91	4	202,581.25	207,959.58	2,139.58	5,378.33	0.35
XS1028599287	ORANGE 5.25 PERP	(EXA)	311299	250,000.	M EUR	114.6266	% 31/03/17	110.275	4	286,566.60	277,701.20	2,013.70	-8,865.40	0.47
XS1028950886	NOVAFIVES FIX 300621	(360)	300621	200,000.	M EUR	91.4456	% 31/03/17	99.423	4	182,891.25	200,821.00	1,975.00	17,929.75	0.34
XS1028954367	OVAKO GRO FIX 010619	(EUR)	010619	300,000.	M EUR	101.5527	% 31/03/17	101.851	4	304,658.05	312,215.50	6,662.50	7,557.45	0.53
XS1028956222	NUMERICAB FIX 150522	(EUR)	150522	500,000.	M EUR	104.7763	% 31/03/17	104.441	4	523,881.53	525,862.99	3,657.99	1,981.46	0.90

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 31/03/17

DEVISE de fixing : FXR Cours REUTERS

PORTEFUEUILLE : 106004 OBJECTIF ALPHA HAUT RENDEMENT VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : NPC - TYPE D'INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR, Tris

V A L E U R		STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET		DEV	P.R.U EN DEVISE		DATE	COURS	I	<-----		Devise du portefeuille			----->		PRCT
		VAL/LIGNE		EXPR.	QUANTITE	COT	ET EXPR.	COURS	COTA	VALEUR	F	PRIX	REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON	COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	ACT NET	
XS1028956909	3AB OPTIQ FIX 150419		(USA) 150419		200,000.	M EUR	102.25	%	31/03/17	101.209	4	204,500.00		207,699.25		5,281.25	3,199.25	0.35	
XS1040428721	KERNEOS 5 3/4 01/21		(USA) 010321		300,000.	M EUR	107.9972	%	31/03/17	103.5	4	323,991.67		312,081.25		1,581.25	-11,910.42	0.53	
XS1044528849	LABERE 5 5/8 03/15/2		(EUR) 150321		350,000.	M EUR	103.738	%	31/03/17	103.011	4	363,082.95		361,577.56		1,039.06	-1,505.39	0.62	
XS1048568452	FIAT 4.75% 032221		(366) 220321		700,000.	M EUR	111.3274	%	31/03/17	110.506	4	779,291.56		774,726.25		1,184.25	-4,565.31	1.32	
XS1050460739	TELEF EUROPE 5% 99		(366) 311299		400,000.	M EUR	103.6032	%	31/03/17	105.856	4	414,412.92		423,643.18		219.18	9,230.26	0.72	
XS1050461034	TELEFO 5 7/8 12/31/4		(EXA) 311299		200,000.	M EUR	105.5558	%	31/03/17	109.574	4	211,111.64		219,276.77		128.77	8,165.13	0.37	
XS1061642317	ALTI LUX 7.25 05-22		(EUR) 150522		450,000.	M EUR	109.9281	%	31/03/17	105.945	4	494,676.60		481,193.13		4,440.63	-13,483.47	0.82	
XS1074935492	MONI HOL 6.88 06-22		(EUR) 150622		300,000.	M EUR	90.6889	%	31/03/17	97.919	4	272,066.81		300,001.79		6,244.79	27,934.98	0.51	
XS1075833860	HEMABV 6.25% 061519		(EUR) 150619		400,000.	M EUR	96.6875	%	31/03/17	98.035	4	386,750.01		399,709.44		7,569.44	12,959.43	0.68	
XS1078234330	SELECTA G FIX 150620		(360) 150620		400,000.	M EUR	99.6674	%	31/03/17	98.071	4	398,669.44		400,156.22		7,872.22	1,486.78	0.68	
XS1082473395	BOPARAN F FIX 150721		(USA) 150721		300,000.	M EUR	102.6445	%	31/03/17	99.819	4	307,933.34		301,243.46		1,786.46	-6,689.88	0.51	
XS1082636876	WIND ACQU FIX 150720		(EUR) 150720	1,500,000.	M EUR		98.0025	%	31/03/17	101.768	4	1,470,037.61		1,539,686.67		13,166.67	69,649.06	2.62	
XS1084568762	MTNA 2 7/8 07/06/20		(EXA) 060720		300,000.	M EUR	107.3312	%	31/03/17	105.312	4	321,993.70		322,363.40		6,427.40	369.70	0.55	
XS1087753353	DUFYR FIN FIX 150722		(USA) 150722		300,000.	M EUR	105.21	%	31/03/17	104.533	4	315,630.00		316,561.50		2,962.50	931.50	0.54	
XS1087760648	THOM EURO FIX 150719		(USA) 150719		400,000.	M EUR	104.9637	%	31/03/17	103.722	4	419,854.86		421,361.61		6,473.61	1,506.75	0.72	
XS1089828880	LOXAM FIX 230722		(USA) 230722		200,000.	M EUR	102.98	%	31/03/17	106.474	4	205,960.00		217,186.89		4,238.89	11,226.89	0.37	
XS1093814116	HOMEVI FIX 150821		(360) 150821		400,000.	M EUR	108.2547	%	31/03/17	105.169	4	433,018.75		424,419.06		3,743.06	-8,599.69	0.72	
XS1094612378	LOCK AS FIX 150821		(360) 150821		250,000.	M EUR	101.2111	%	31/03/17	105.688	4	253,027.78		266,601.94		2,381.94	13,574.16	0.45	
XS1109795176	ORIGIN EN FLO 160974		(UST) 160974		200,000.	M EUR	101.2707	%	31/03/17	101.647	4	202,541.44		203,702.60		408.60	1,161.16	0.35	
XS1115490523	ORAN TM 4.0 PERP		(366) 311299		200,000.	M EUR	105.9894	%	31/03/17	105.547	4	211,978.82		215,148.79		4,054.79	3,169.97	0.37	
XS1117280112	GRUP EMP 5.38 11-22		(360) 011122		200,000.	M EUR	106.7067	%	31/03/17	107.562	4	213,413.33		219,692.75		4,568.75	6,279.42	0.37	
XS1117295060	XPO LOGI 5.75 06-21		(360) 150621		500,000.	M EUR	103.6232	%	31/03/17	104.969	4	518,115.97		533,549.86		8,704.86	15,433.89	0.91	
XS1117298833	PICA BON 7.75 02-20		(360) 010220		750,000.	M EUR	102.2865	%	31/03/17	105.241	4	767,148.96		799,479.38		10,171.88	32,330.42	1.36	
XS1117300241	ALTI LUX 6.25 02-25		(360) 150225		250,000.	M EUR	95.0429	%	31/03/17	106.721	4	237,607.20		266,932.71		130.21	29,325.51	0.45	
XS1137505290	ALLGRP 6 1/4 12/01/2		(360) 011221		300,000.	M EUR	97.1875	%	31/03/17	106.221	4	291,562.50		325,069.25		6,406.25	33,506.75	0.55	
XS1139494493	GAS NATU 4.13 11-49		(366) 311299		200,000.	M EUR	106.6732	%	31/03/17	104.104	4	213,346.31		211,304.58		3,096.58	-2,041.73	0.36	
XS1150437579	UNIT 01-25		(360) 150125		500,000.	M EUR	100.5742	%	31/03/17	104.232	4	502,871.11		525,548.89		4,388.89	22,677.78	0.89	
XS1151723282	CONS NV 01-23		(EUR) 150123		400,000.	M EUR	93.1967	%	31/03/17	102.683	4	372,786.66		416,876.44		6,144.44	44,089.78	0.71	
XS1153374084	AURI LUX 8.0 01-23		(EUR) 150123		200,000.	M EUR	114.0278	%	31/03/17	108.574	4	228,055.56		220,659.11		3,511.11	-7,396.45	0.38	
XS1169832810	TELE ITA 3.25 01-23		(366) 160123		500,000.	M EUR	103.32	%	31/03/17	106.27	4	516,599.93		534,822.60		3,472.60	18,222.67	0.91	
XS1169920193	VIRG MED 4.5 01-25		(360) 150125		175,000.	M EUR	100.2846	%	31/03/17	103.598	4	175,498.09		183,024.63		1,728.13	7,526.54	0.31	
XS1180324037	SILK BID 7.5 02-22		(EUR) 010222		200,000.	M EUR	102.9583	%	31/03/17	107.738	4	205,916.66		218,101.00		2,625.00	12,184.34	0.37	
XS1181246775	ALTI FIN 5.25 02-23		(360) 150223		800,000.	M EUR	104.6484	%	31/03/17	106.98	4	837,187.50		856,190.00		350.00	19,002.50	1.46	
XS1195581159	TDC AS 3.5 02-15		(366) 260215		400,000.	M EUR	98.4812	%	31/03/17	99.445	4	393,924.59		399,199.18		1,419.18	5,274.59	0.68	
XS1205619288	VRX ESCR 4.5 05-23		(360) 150523		500,000.	M EUR	94.2037	%	31/03/17	73.758	4	471,018.41		377,477.50		8,687.50	-93,540.91	0.64	
XS1207058733	REPS SA 4.5 03-75		(366) 250375		500,000.	M EUR	91.039	%	31/03/17	101.386	4	455,195.07		507,546.44		616.44	52,351.37	0.86	
XS1207105161	PAPREC 7.375 04-23		(EUR) 010423		200,000.	M EUR	104.3111	%	31/03/17	106.649	4	208,622.22		213,420.92		122.92	4,798.70	0.36	
XS1207387801	VWR FUND 4.63 04-22		(360) 150422		300,000.	M EUR	99.25	%	31/03/17	104.181	4	297,750.00		319,056.54		6,513.54	21,306.54	0.54	
XS1211292484	ANGL AME 1.5 04-20		(366) 010420		900,000.	M EUR	80.9419	%	31/03/17	101.705	4	728,477.45		915,455.96		110.96	186,978.51	1.56	
XS1212668062	TA MFG L 3.63 04-23		(360) 150423		400,000.	M EUR	96.1139	%	31/03/17	101.719	4	384,455.55		413,682.94		6,806.94	29,227.39	0.70	
XS1219475792	MATT TEL 4.875 05-23		(360) 010523		300,000.	M EUR	97.5486	%	31/03/17	100.275	4	292,645.83		307,040.63		6,215.63	14,394.80	0.52	
XS1220246521	TRIN MAT 6.38 05-22		(360) 010522		100,000.	M EUR	101.8697	%	31/03/17	106.997	4	101,869.68		109,706.38		2,709.38	7,836.70	0.19	
XS1222584325	KLOC PEN 7.13 11-20		(360) 011120		300,000.	M EUR	108.9021	%	31/03/17	104.	4	326,706.25		321,084.38		9,084.38	-5,621.87	0.55	
XS1223808749	RAPI HOL 6.63 11-20		(360) 151120		400,000.	M EUR	103.0922	%	31/03/17	103.228	4	412,368.75		423,143.94		10,231.94	10,775.19	0.72	
XS1224710399	GAS NATU 3.38 12-99		(366) 311299		400,000.	M EUR	92.762	%	31/03/17	97.651	4	371,047.95		403,364.27		12,760.27	32,316.32	0.69	
XS1224953882	EURO SCI 4.88 PERP		(366) 311299		300,000.	M EUR	106.1137	%	31/03/17	105.551	4	318,341.09		330,276.29		13,623.29	11,935.20	0.56	
XS1232126810	VOTO CIM 3.5 07-22		(EXA) 130722		400,000.	M EUR	96.6819	%	31/03/17	100.499	4	386,727.51		412,160.38		10,164.38	25,432.87	0.70	
XS1244815111	CMA CGM 7.75 01-21		(360) 150121		250,000.	M EUR	85.4392	%	31/03/17	101.214	4	213,597.92		257,286.74		4,251.74	43,688.82	0.44	

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 31/03/17

DEVISE de fixing : FXR Cours REUTERS

PORTFEUILLER : 106004 OBJECTIF ALPHA HAUT RENDEMENT

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TYPE D'INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR, Tris

V A L E U R		STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P.R.U EN DEVISE	DATE	COURS	I	<-----		Devise du portefeuille		----->		PRCT
		VAL/LIGNE		EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR. COURS	COTA	VALEUR	F	PRIX	REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	ACT NET	
XS1251078694 KIRK BEA 8.75 07-23			(360) 150723	200,000.	M EUR	111.5417	% 31/03/17	110.298	4	223,083.33		224,436.28	3,840.28	1,352.95	0.38	
XS1265973047 HORI HOL 7.25 08-23			(360) 010823	400,000.	M EUR	106.9266	% 31/03/17	106.479	4	427,706.25		430,991.00	5,075.00	3,284.75	0.73	
XS1266662334 SOFT GRO 4.75 07-25			(USA) 300725	700,000.	M EUR	106.0148	% 31/03/17	110.854	4	742,103.47		781,889.11	5,911.11	39,785.64	1.33	
XS1266726592 TELE FIN 4.88 07-27			(360) 150727	200,000.	M EUR	98.2483	% 31/03/17	107.547	4	196,496.52		217,233.58	2,139.58	20,737.06	0.37	
XS1268471494 EPHI HOL 8.25 07-23			(999) 010723	250,000.	M EUR	100.5778	% 31/03/17	110.461	4	251,444.44		281,480.63	5,328.13	30,036.19	0.48	
XS1323897725 SOLV FIN 5.87 PERP			(366) 311299	700,000.	M EUR	99.227	% 31/03/17	113.633	4	694,589.08		829,760.63	34,329.63	135,171.55	1.41	
XS1347748607 TELE ITA 3.63 01-24			(366) 190124	300,000.	M EUR	106.9551	% 31/03/17	106.231	4	320,865.41		320,927.59	2,234.59	62.18	0.55	
XS1382783527 THE CHEM 6.13 05-23			(360) 150523	400,000.	M EUR	109.1525	% 31/03/17	107.315	4	436,610.15		438,719.72	9,459.72	2,109.57	0.75	
XS1401114811 MAGY OLA 2.63 04-23			(366) 280423	233,000.	M EUR	99.214	% 31/03/17	104.036	4	231,168.62		248,117.97	5,714.09	16,949.35	0.42	
XS1405765659 SOCI EU 5.625 PERP			(366) 311299	200,000.	M EUR	99.652	% 31/03/17	107.663	4	199,304.00		217,329.42	2,003.42	18,025.42	0.37	
XS1405765907 OI EURO 3.125 11-24			(EUR) 151124	200,000.	M EUR	99.1337	% 31/03/17	100.066	4	198,267.36		202,753.53	2,621.53	4,486.17	0.35	
XS1405769990 INEO GR 5.375 08-24			(EUR) 010824	100,000.	M EUR	99.6551	% 31/03/17	103.778	4	99,655.14		104,718.63	940.63	5,063.49	0.18	
XS1405777746 SOCI EUR 4.63 PERP			(366) 311299	300,000.	M EUR	99.666	% 31/03/17	104.721	4	298,998.00		317,660.26	3,497.26	18,662.26	0.54	
XS1405782316 BISO SAS 5.88 05-23			(360) 010523	350,000.	M EUR	106.728	% 31/03/17	107.461	4	373,548.09		384,852.56	8,739.06	11,304.47	0.66	
XS1405784288 KERLING 6.25 05-21			(USA) 150521	325,000.	M EUR	104.7591	% 31/03/17	105.678	4	340,467.01		351,296.38	7,842.88	10,829.37	0.60	
XS1406669983 ARDA PAC 6.75 05-24			(360) 150524	650,000.	M EUR	101.5263	% 31/03/17	109.675	4	659,921.05		729,828.13	16,940.63	69,907.08	1.24	
XS1419661118 HANE FI 3.5 06-24			(360) 150624	300,000.	M EUR	102.8355	% 31/03/17	102.47	4	308,506.35		310,589.17	3,179.17	2,082.82	0.53	
XS1433214449 CEME FIN 4.63 06-24			(EUR) 150624	300,000.	M EUR	100.	% 31/03/17	106.036	4	300,000.00		322,309.04	4,201.04	22,309.04	0.55	
XS1435229460 PVH EX P 3.63 07-24			(USA) 150724	300,000.	M EUR	104.4167	% 31/03/17	104.023	4	313,250.17		314,455.46	2,386.46	1,205.29	0.54	
XS1458413728 LECTA 6.5 08-23			(EUR) 010823	250,000.	M EUR	100.	% 31/03/17	104.798	4	250,000.00		264,838.75	2,843.75	14,838.75	0.45	
XS1468662801 ADIE GL 3.5 08-24			(EUR) 150824	400,000.	M EUR	102.3632	% 31/03/17	100.868	4	409,452.78		405,377.56	1,905.56	-4,075.22	0.69	
XS1490960942 TELE EU 3.75 PERP			(366) 311299	600,000.	M EUR	99.9581	% 31/03/17	100.436	4	599,748.29		603,848.88	1,232.88	4,100.59	1.03	
XS1491985476 EDRE OD 8.5 08-21			(EUR) 010821	300,000.	M EUR	98.8113	% 31/03/17	108.023	4	296,433.75		328,531.50	4,462.50	32,097.75	0.56	
XS1492822033 IMS HEA 3.5 10-24			(USA) 151024	200,000.	M EUR	103.815	% 31/03/17	102.377	4	207,630.00		208,370.67	3,616.67	740.67	0.35	
XS1500468407 SCHO AL 8.0 10-21			(EUR) 011021	300,000.	M EUR	100.	% 31/03/17	107.709	4	300,000.00		323,327.00	200.00	23,327.00	0.55	
XS1501166869 TOTA SA 3.369 PERP			(366) 311299	470,000.	M EUR	99.6702	% 31/03/17	99.025	4	468,450.00		473,226.20	7,808.70	4,776.20	0.81	
XS1504057008 NW GLOB 7.0 10-23			(EUR) 151023	200,000.	M EUR	105.3306	% 31/03/17	104.974	4	210,661.11		216,559.11	6,611.11	5,898.00	0.37	
XS1512670412 MOBI FI 5.5 11-24			(EUR) 151124	275,000.	M EUR	100.3053	% 31/03/17	102.378	4	275,839.47		287,589.50	6,050.00	11,750.03	0.49	
XS1531306717 THOM CO 6.25 06-22			(EUR) 150622	400,000.	M EUR	101.8153	% 31/03/17	107.567	4	407,261.04		438,323.56	8,055.56	31,062.52	0.75	
XS1531338678 CATA PH 4.75 12-24			(EUR) 151224	200,000.	M EUR	104.7965	% 31/03/17	105.886	4	209,593.06		214,806.72	3,034.72	5,213.66	0.37	
XS1533914591 HP PELZ 4.125 04-24			(EUR) 010424	225,000.	M EUR	100.2222	% 31/03/17	100.826	4	225,500.00		226,858.50	0.00	1,358.50	0.39	
XS1533922776 IMS HEA 3.25 03-25			(EUR) 150325	250,000.	M EUR	100.	% 31/03/17	99.647	4	250,000.00		249,930.00	812.50	-70.00	0.43	
XS1551678409 TITIM 2 1/2 07/19/23			(EXA) 190723	150,000.	M EUR	99.3548	% 31/03/17	101.243	4	149,032.12		152,635.05	770.55	3,602.93	0.26	
XS1555576641 HAPA LL 6.75 02-22			(EUR) 010222	300,000.	M EUR	101.3188	% 31/03/17	105.684	4	303,956.25		320,595.75	3,543.75	16,639.50	0.55	
XS1568874983 PETR ME 3.75 02-24			(366) 210224	330,000.	M EUR	99.463	% 31/03/17	101.87	4	328,227.90		337,594.97	1,423.97	9,367.07	0.57	
XS1574789746 NYRS NE 6.875 03-24			(EUR) 150324	200,000.	M EUR	100.9292	% 31/03/17	100.37	4	201,858.47		201,656.67	916.67	-201.80	0.34	
XS1580364286 MATT TE 4.875 05-23			(EUR) 010523	500,000.	M EUR	101.8281	% 31/03/17	100.238	4	509,140.63		511,549.38	10,359.38	2,408.75	0.87	
XS1581375000 MERL EN 2.75 03-22			(EUR) 150322	300,000.	M EUR	103.5153	% 31/03/17	103.395	4	310,545.83		310,620.42	435.42	74.59	0.53	
XS1583063794 PAPREC 5.25 04-22			(EUR) 010422	250,000.	M EUR	107.0083	% 31/03/17	104.631	4	267,520.84		261,686.88	109.38	-5,833.96	0.45	
XS1584024837 NEWC SA 5.375 04-25			(UST) 150425	250,000.	M EUR	100.	% 31/03/17	100.375	4	250,000.00		250,937.50	0.00	937.50	0.43	
XS1586831999 ARAM IN 3.125 04-25			(EUR) 010425	150,000.	M EUR	100.	% 31/03/17	101.272	4	150,000.00		151,999.15	91.15	1,999.15	0.26	
XS1590066624 LOXAM 4.25 04-24			(EUR) 150424	400,000.	M EUR	100.4375	% 31/03/17	101.726	4	401,750.00		406,904.00	0.00	5,154.00	0.69	
Sous Total Devise de valeur EUR EURO										CUMUL (EUR)		49,110,133.96	50,458,242.13	710,381.03	1,348,108.17	85.89

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 31/03/17

PORTFEUILLE : 106004 OBJECTIF ALPHA HAUT RENDEMENT

VL VALIDEE

Devise de fixing : FXR Cours REUTERS

Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : NPC - TYPE D'INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR, Tris

V A L E U R		STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET		DEV	P.R.U EN DEVISE		DATE	COURS	I	<-----		Devise du portefeuille			----->		PRCT							
		VAL/LIGNE		EXPR.	QUANTITE	COT	ET	EXPR.	COURS	COTA	VALEUR	F	PRIX	REVIENT	TOTA	VALEUR	BOURSIERE	COUPON	COURU	TOTA	PLUS	OU	MOINS	VAL	ACT	NET
Obligations à taux variable, révisable négo. sur u																										
Devise de valeur EUR EURO																										
FR0011052661 CASINO GUI FLO 5-21			(366)	260521	300,000.	M	EUR	111.3996	%	31/03/17	116.999	4	334,198.77		366,370.87		15,373.87				32,172.10			0.62		
XS1054086928 QUICK E3R 150419			(999)	150419	300,000.	M	EUR	90.514	%	31/03/17	97.7	4	222,170.62		242,131.17		2,322.08				19,960.55			0.41		
XS1084586822 IGLO FOOD FLO 150620			(999)	150620	200,000.	M	EUR	98.9148	%	31/03/17	100.949	4	197,829.54		202,361.33		463.33				4,531.79			0.34		
XS1459821036 NAVI ARMA FLR 07-23			(EUR)	310723	300,000.	M	EUR	99.	%	31/03/17	105.768	4	297,000.00		320,770.67		3,466.67				23,770.67			0.55		
XS1496169001 MCS GROUPE FLR 09-21			(999)	300921	200,000.	M	EUR	103.5958	%	31/03/17	102.985		207,191.67		206,090.44		120.44				-1,101.23			0.35		
Sous Total Devise de valeur EUR EURO																										
													CUMUL (EUR)		1,258,390.60		1,337,724.48		21,746.39			79,333.88		2.28		
Obligations & valeurs assimilées négociés sur un marché réglementé																										
													CUMUL (EUR)		50,368,524.56		51,795,966.61		732,127.42			1,427,442.05		88.17		
III - Titres d'OPCVM																										
OPCVM français à vocation générale																										
Devise de valeur EUR EURO																										
FR0010941815 OBJ.MON.EURO B 3D					5.4	P	EUR	1034844.7167	M	30/03/17	1034350.02	Y	5,588,161.47		5,585,490.11		0.00				-2,671.36			9.51		
VIII - TRESORERIE																										
Dettes et créances																										
Règlements différés																										
ARDEUR Ach rglt différé					-1,079,216.37		EUR	1.			1.		-1,079,216.37		-1,079,216.37		0.00				0.00			-1.84		
RACHEUR Rachats a payer					-1,583.02		EUR	1.			1.		-1,583.02		-1,583.02		0.00				0.00			0.00		
SOUSEUR Souscriptions/payer					49,073.62		EUR	1.			1.		49,073.62		49,073.62		0.00				0.00			0.08		
VRDEUR Vte rglt différé					417,405.67		EUR	1.			1.		417,405.67		417,405.67		0.00				0.00			0.71		
Règlements différés																										
													CUMUL (EUR)		-614,320.10		-614,320.10		0.00			0.00		-1.05		
Coupons et dividendes en espèces																										
XS0867945197 RAIN CII 8.5% 01/21					300.	P	EUR	18.41666667		31/03/17			5,525.00		5,525.00		0.00				0.00			0.01		
XS1117300241 ALTI LUX 6.25 02-25					250.	P	EUR	31.25		31/03/17			7,812.50		7,812.50		0.00				0.00			0.01		
XS1181246775 ALTI FIN 5.25 02-23					800.	P	EUR	26.25		31/03/17			21,000.00		21,000.00		0.00				0.00			0.04		
XS1207105161 PAPREC 7.375 04-23					200.	P	EUR	36.875		31/03/17			7,375.00		7,375.00		0.00				0.00			0.01		
XS1211292484 ANGL AME 1.5 04-20					900.	P	EUR	15.		31/03/17			13,500.00		13,500.00		0.00				0.00			0.02		
XS1500468407 SCHO AL 8.0 10-21					300.	P	EUR	38.66666667		31/03/17			11,600.00		11,600.00		0.00				0.00			0.02		
XS1583063794 PAPREC 5.25 04-22					250.	P	EUR	26.25		31/03/17			6,562.50		6,562.50		0.00				0.00			0.01		
Coupons et dividendes en espèces																										
													CUMUL (EUR)		73,375.00		73,375.00		0.00			0.00		0.12		
Frais de gestion																										
FGPFC2EUR Frais de ges.var fig					-1,398.15		EUR	1.			1.		-1,398.15		-1,398.15		0.00				0.00			0.00		
FGPFD4EUR Frais de ges.var fig					-8.13		EUR	1.			1.		-8.13		-8.13		0.00				0.00			0.00		
FGPVFEUR Frais de Gest. Fixe					-106,363.9		EUR	1.			1.		-106,363.90		-106,363.90		0.00				0.00			-0.18		
FGPVVC2EUR Frais de Gest. var.					-32,855.62		EUR	1.			1.		-32,855.62		-32,855.62		0.00				0.00			-0.06		
FGPVVD4EUR Prov FDG variables D					-1,535.15		EUR	1.			1.		-1,535.15		-1,535.15		0.00				0.00			0.00		

Stock : Stock admi principal au 31/03/17

Devise de fixing : FXR Cours REUTERS

Portefeuille : 106004 OBJECTIF ALPHA HAUT RENDEMENT

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TYPE D'INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR, Tris

V A L E U R				STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<----- PRIX REVIENT TOTA			Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE COUPON COURU TOTA			-----> PLUS OU MOINS VAL		PRCT ACT NET		
Frais de gestion																						
									CUMUL	(EUR)			-142,160.95			-142,160.95			0.00		0.00	-0.24
Dettes et créances																						
									CUMUL	(EUR)			-683,106.05			-683,106.05			0.00		0.00	-1.16
Disponibilités																						
Avoirs en france																						
BQCEUR	CACEIS Bank					2,046,103.09	EUR	1.		1.		2,046,103.09			2,046,103.09			0.00		0.00	3.48	
VIII - TRESORERIE																						
									CUMUL	(EUR)			1,362,997.04			1,362,997.04			0.00		0.00	2.32
PORTEFEUILLE : OBJECTIF ALPHA HAUT RENDEMENT (106004)																						
										(EUR)			57,319,683.07			58,744,453.76			732,127.42		1,424,770.69	100.00

Devise de fixing : FXR Cours REUTERS

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TYPE D'INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR, Tris

Frais de gestion du jour

Frais de Gest. var. :	1,328.62	EUR
Prov FDG variables D :	52.65	EUR
Frais de ges.var fig :	0.88	EUR
Frais de Gest. Fixe :	1,050.72	EUR
Frais de Gest. Fixe :	41.64	EUR

Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
C2 FR0010505313 OBJEC AJP HAUT RDT C	EUR	56,505,087.47	35,676.	1,583.84	96.187952889085		1,647.19	1,520.48
D4 FR0010597138 OBJEC ALP HAUT RDT D	EUR	2,239,366.29	2,202.	1,016.96	3.812047110915		1,057.63	976.28

Actif net total en EUR : 58,744,453.76

Precedente VL en date du 30/03/17 :

C2	PARTS CAPI 2	Prec. VL :	1,583.02	(EUR)	Variation :	+0.052%
D4	PARTS DIST 4	Prec. VL :	1,016.44	(EUR)	Variation :	+0.051%

VL theorique

Part	Devise	Actif net	Valeur liquidative
C2 FR0010505313 OBJEC AJP HAUT RDT C	EUR	56,505,087.47	1,583.84
D4 FR0010597138 OBJEC ALP HAUT RDT D	EUR	2,239,366.29	1,016.96

Actif net total en EUR : 58,744,453.76 (Sens collecte : EQU)