

**FIA**

# **AUTOFOCUS ESG JUIN 2022**

## **RAPPORT SEMESTRIEL**

*27/03/2025*

**Société de Gestion : ARKEA ASSET MANAGEMENT**  
**Dépositaire : Caceis Bank**  
**Commissaire aux Comptes : Forvis Mazars**

## ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR

| Éléments de l'état du patrimoine                                                                              | Montant à l'arrêté<br>périodique (*) |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------|
| a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-24-55 du code monétaire et financier | 10 417 851,35                        |
| b) Avoirs bancaires                                                                                           |                                      |
| c) Autres actifs détenus par l'OPC                                                                            | 436 998,94                           |
| d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)                                                          | 10 854 850,29                        |
| e) Passif                                                                                                     | -1 561 847,20                        |
| f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)                                                | 9 293 003,09                         |

(\*) Les montants sont signés

## NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART

| Part                    | Type de part | Actif net de la part | Nombre de parts<br>en circulation | Valeur nette<br>d'inventaire par<br>part |
|-------------------------|--------------|----------------------|-----------------------------------|------------------------------------------|
| AUTOFOCUS ESG JUIN 2022 | C            | 9 293 003,09         | 90 975,000                        | 102,15                                   |

## ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

| Eléments du portefeuille titres                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | Pourcentage actif net<br>(*) | Pourcentage total des<br>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.<br><br>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.        | 112,10                       | 95,97                                |
| 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 du fonds d'investissement à vocation générale. | 0,00                         | 0,00                                 |
| D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4 ° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           | 0,00                         | 0,00                                 |
| E) Les autres actifs.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          | 0,00                         | 0,00                                 |

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

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

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

| Titres       | Devise | En montant (EUR)     | Pourcentage actif net (*) | Pourcentage total des actifs (**) |
|--------------|--------|----------------------|---------------------------|-----------------------------------|
| Euro         | EUR    | 10 417 851,35        | 112,10                    | 95,97                             |
| <b>TOTAL</b> |        | <b>10 417 851,35</b> | <b>112,10</b>             | <b>95,97</b>                      |

(\*) 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<br>(*) | Pourcentage total des<br>actifs (**) |
|--------------|------------------------------|--------------------------------------|
| FRANCE       | 78,05                        | 66,82                                |
| ALLEMAGNE    | 25,43                        | 21,77                                |
| PAYS-BAS     | 8,62                         | 7,38                                 |
| <b>TOTAL</b> | <b>112,10</b>                | <b>95,97</b>                         |

(\*) 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<br>(*) | Pourcentage total des<br>actifs (**) |
|-------------------------------------------------------------------|------------------------------|--------------------------------------|
| OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne | 0,00                         | 0,00                                 |
| Autres OPC et fonds d'investissements                             | 0,00                         | 0,00                                 |
| FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne   | 0,00                         | 0,00                                 |
| Autres                                                            | 0,00                         | 0,00                                 |
| <b>TOTAL</b>                                                      | <b>0,00</b>                  | <b>0,00</b>                          |

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

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

## MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

| Eléments 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.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 4 174 242,54            | 4 391 137,47 |
| 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.                                                                                                                                                                                                       |                         |              |
| 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 du fonds d'investissement à vocation générale. |                         |              |
| D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4 ° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |                         |              |
| E) Les autres actifs.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |                         | 424 992,38   |

## INFORMATIONS DIVERSES

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

Le relevé Périodicité Semestrielle détaillé de l'actif est disponible dans un délai de huit semaines à compter de la fin de la période. Il peut être transmis sur simple demande auprès de la société de gestion :

**ARKEA ASSET MANAGEMENT** - *1 Allée Louis Lichou - 29480 - Le Relecq-Kerhuon*

## INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS

### Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)                           | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle      | % Actif Net   |
|------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------|----------------------|---------------|
| <b>ACTIONS ET VALEURS ASSIMILÉES</b>                                         |        |                     | <b>9 528 513,55</b>  | <b>102,53</b> |
| Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé |        |                     | <b>9 528 513,55</b>  | <b>102,53</b> |
| <b>Assurance</b>                                                             |        |                     | <b>2 002 874,70</b>  | <b>21,55</b>  |
| AXA SA                                                                       | EUR    | 49 947              | 2 002 874,70         | 21,55         |
| <b>Automobiles</b>                                                           |        |                     | <b>801 224,51</b>    | <b>8,62</b>   |
| STELLANTIS NV                                                                | EUR    | 73 426              | 801 224,51           | 8,62          |
| <b>Logiciels</b>                                                             |        |                     | <b>2 363 003,00</b>  | <b>25,43</b>  |
| EVONIK INDUSTRIES AG                                                         | EUR    | 115 100             | 2 363 003,00         | 25,43         |
| <b>Producteur et commerce d'énergie indépendants</b>                         |        |                     | <b>2 325 832,08</b>  | <b>25,03</b>  |
| AIR LIQUIDE PF                                                               | EUR    | 13 182              | 2 325 832,08         | 25,03         |
| <b>Produits alimentaires</b>                                                 |        |                     | <b>2 035 579,26</b>  | <b>21,90</b>  |
| DANONE                                                                       | EUR    | 28 743              | 2 035 579,26         | 21,90         |
| <b>TITRES FINANCIERS MIS EN DÉPOSIT</b>                                      |        |                     | <b>889 337,80</b>    | <b>9,57</b>   |
| Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé |        |                     | <b>889 337,80</b>    | <b>9,57</b>   |
| <b>Assurance</b>                                                             |        |                     | <b>889 337,80</b>    | <b>9,57</b>   |
| AXA SA                                                                       | EUR    | 22 178              | 889 337,80           | 9,57          |
| <b>Total</b>                                                                 |        |                     | <b>10 417 851,35</b> | <b>112,10</b> |

(\*) Le secteur d'activité représente l'activité principale de l'émetteur de l'instrument financier ; il est issu de sources fiables reconnues au plan international (GICS et NACE principalement).

### Inventaire des opérations à terme de devises

| Type d'opération | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |             |                      |             |
|------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|-------------|----------------------|-------------|
|                  | Actif                              | Passif | Devises à recevoir (+)      |             | Devises à livrer (-) |             |
|                  |                                    |        | Devise                      | Montant (*) | Devise               | Montant (*) |
| <b>Total</b>     |                                    |        |                             |             |                      |             |

(\*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions exprimé dans la devise de comptabilisation.

## Inventaire des instruments financiers à terme

### Inventaire des instruments financiers à terme - actions

| Nature d'engagements         | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |                      | Montant de l'exposition (*) |
|------------------------------|---------------------|------------------------------------|----------------------|-----------------------------|
|                              |                     | Actif                              | Passif               | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |                      |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     |                                    |                      |                             |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |                      |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     |                                    |                      |                             |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |                      |                             |
| NATIXIS 08/07/27             | 9 222 500           | 367 055,50                         |                      | 9 222 500,00                |
| NATIXIS PEA 08/07/27         | 9 222 500           |                                    | -1 277 084,52        | 9 222 500,00                |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     | <b>367 055,50</b>                  | <b>-1 277 084,52</b> | <b>18 445 000,00</b>        |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |                      |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     |                                    |                      |                             |
| <b>Total</b>                 |                     | <b>367 055,50</b>                  | <b>-1 277 084,52</b> | <b>18 445 000,00</b>        |

(\*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

### Inventaire des instruments financiers à terme - taux d'intérêts

| Nature d'engagements         | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|------------------------------|---------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
|                              |                     | Actif                              | Passif | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>Total</b>                 |                     |                                    |        |                             |

(\*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

### Inventaire des instruments financiers à terme - de change

| Nature d'engagements  | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|-----------------------|---------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
|                       |                     | Actif                              | Passif | +/-                         |
| 1. Futures            |                     |                                    |        |                             |
| Sous-total 1.         |                     |                                    |        |                             |
| 2. Options            |                     |                                    |        |                             |
| Sous-total 2.         |                     |                                    |        |                             |
| 3. Swaps              |                     |                                    |        |                             |
| Sous-total 3.         |                     |                                    |        |                             |
| 4. Autres instruments |                     |                                    |        |                             |
| Sous-total 4.         |                     |                                    |        |                             |
| <b>Total</b>          |                     |                                    |        |                             |

(\*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

### Inventaire des instruments financiers à terme - sur risque de crédit

| Nature d'engagements  | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|-----------------------|---------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
|                       |                     | Actif                              | Passif | +/-                         |
| 1. Futures            |                     |                                    |        |                             |
| Sous-total 1.         |                     |                                    |        |                             |
| 2. Options            |                     |                                    |        |                             |
| Sous-total 2.         |                     |                                    |        |                             |
| 3. Swaps              |                     |                                    |        |                             |
| Sous-total 3.         |                     |                                    |        |                             |
| 4. Autres instruments |                     |                                    |        |                             |
| Sous-total 4.         |                     |                                    |        |                             |
| <b>Total</b>          |                     |                                    |        |                             |

(\*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

### Inventaire des instruments financiers à terme - autres expositions

| Nature d'engagements  | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|-----------------------|---------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
|                       |                     | Actif                              | Passif | +/-                         |
| 1. Futures            |                     |                                    |        |                             |
| Sous-total 1.         |                     |                                    |        |                             |
| 2. Options            |                     |                                    |        |                             |
| Sous-total 2.         |                     |                                    |        |                             |
| 3. Swaps              |                     |                                    |        |                             |
| Sous-total 3.         |                     |                                    |        |                             |
| 4. Autres instruments |                     |                                    |        |                             |
| Sous-total 4.         |                     |                                    |        |                             |
| <b>Total</b>          |                     |                                    |        |                             |

(\*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

## Inventaire des instruments financiers à terme ou des opérations à terme de devises utilisés en couverture d'une catégorie de part

L'OPC sous revue n'est pas concerné par cette rubrique.

### Synthèse de l'inventaire

|                                                                                      | Valeur actuelle présentée au bilan |
|--------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|
| Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)                          | 10 417 851,35                      |
| Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :               |                                    |
| Total opérations à terme de devises                                                  |                                    |
| Total instruments financiers à terme - actions                                       | -910 029,02                        |
| Total instruments financiers à terme - taux                                          |                                    |
| Total instruments financiers à terme - change                                        |                                    |
| Total instruments financiers à terme - crédit                                        |                                    |
| Total instruments financiers à terme - autres expositions                            |                                    |
| Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises |                                    |
| Autres actifs (+)                                                                    | 69 943,44                          |
| Autres passifs (-)                                                                   | -284 762,68                        |
| Passifs de financement (-)                                                           |                                    |
| <b>Total = actif net</b>                                                             | <b>9 293 003,09</b>                |

| Libellé de la part           | Devise de la part | Nombre de parts | Valeur liquidative |
|------------------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| Part AUTOFOCUS ESG JUIN 2022 | EUR               | 90 975,000      | 102,15             |