

INFORMATIONS SEMESTRIELLES JUIN 2024

AMUNDI FRN CREDIT EURO VALUE FACTOR

OPCVM de droit français

Société de Gestion

Amundi Asset Management

Sous délégataire de gestion comptable en titre

Caceis Fund Administration

Dépositaire

CACEIS BANK

Commissaire aux Comptes

DELOITTE & ASSOCIÉS

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	52 730 916,41
b) Avoirs bancaires	131 572,39
c) Autres actifs détenus par l'OPC	2 195 404,42
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	55 057 893,22
e) Passif	-481 107,27
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	54 576 785,95

^(*) 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 en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
AMUNDI FRN CREDIT EURO VALUE FACTOR-I(C) en EUR	С	37 357 728,02	33 200,000	1 125,2327
AMUNDI FRN CREDIT EURO VALUE FACTOR- I2(C) en EUR	С	17 218 941,99	1 639,206	10 504,4405
AMUNDI FRN CREDIT EURO VALUE FACTOR-P(C) en EUR	С	115,94	1,000	115,9400

Eléments du portefeuille titres

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier.	70,06	69,44
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 de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	26,56	26,33
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du l de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	2,11	2,09

^(*) 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	52 730 916,41	96,62	95,77
TOTAL		52 730 916,41	96,62	95,77

^(*) 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	16,26	16,12
PAYS-BAS	12,57	12,46
ETATS-UNIS	11,89	11,78
ROYAUME-UNI	11,03	10,93
ALLEMAGNE	7,86	7,80
BELGIQUE	7,36	7,30
LUXEMBOURG	5,87	5,82
DANEMARK	3,07	3,05
AUTRICHE	3,02	2,99
SUEDE	2,95	2,93
REPUBLIQUE TCHEQUE	2,81	2,79
FINLANDE	2,63	2,60
ESPAGNE	2,24	2,22
ITALIE	2,21	2,19
JAPON	1,27	1,26
ILES CAIMANS	1,25	1,24
IRLANDE	1,20	1,19
HONGRIE	1,13	1,12
TOTAL	96,62	95,77

^(*) 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 (**)
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	2,11	2,09
Autres OPC et fonds d'investissements		
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne		
Autres		
TOTAL	2,11	2,09

^(*) 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

Elémente du nertefeuille titres	Mouvements	(en montant)
Eléments du portefeuille titres	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.	62 892 757,86	57 986 760,03
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 de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	25 640 957,32	30 794 374,08
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.	25 151 110,75	26 557 178,99

Information sur les commissions de surperformance (En EUR)

	28/06/2024
Part AMUNDI FRN CREDIT EURO VALUE FACTOR-I(C)	
Frais de gestion variables acquis	
Pourcentage de frais de gestion variables acquis (1)	
Frais de gestion variables acquis (dus aux rachats)	
Pourcentage de frais de gestion variables acquis (dus aux rachats) (2)	
Part AMUNDI FRN CREDIT EURO VALUE FACTOR-I2(C)	
Frais de gestion variables acquis	
Pourcentage de frais de gestion variables acquis (1)	
Frais de gestion variables acquis (dus aux rachats)	
Pourcentage de frais de gestion variables acquis (dus aux rachats) (2)	
Part AMUNDI FRN CREDIT EURO VALUE FACTOR-P(C)	
Frais de gestion variables acquis	
Pourcentage de frais de gestion variables acquis (1)	
Frais de gestion variables acquis (dus aux rachats)	
Pourcentage de frais de gestion variables acquis (dus aux rachats) (2)	

⁽¹⁾ par rapport à l'actif net de l'arrêté comptable

⁽²⁾ par rapport à l'actif net moyen

Transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation des instruments financiers Règlement 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 règlementation SFTR.

Inventaire des actifs et passifs

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)		Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES			52 730 916,41	96,62
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			52 730 916,41	96,62
Assurance			4 909 371,71	9,00
AGEAS NV EX FORTIS 1.875% 24-11-51	EUR	900 000	753 389,12	1,38
ALLIANZ SE 5.824% 25-07-53	EUR	700 000	805 594,57	1,48
ATHORA NETHERLANDS NV 5.375% 31-08-32	EUR	850 000	878 009,79	1,60
HANNOVER RUCKVERSICHERUNGS AKTIENGESELLS 5.875% 26-08-43	EUR	600 000	696 116,27	1,28
LA MONDIALE 0.75% 20-04-26	EUR	900 000	850 477,61	1,56
LIBERTY MUTUAL GROUP 4.625% 02-12-30	EUR	200 000	211 484,66	0,39
MUTUELLE ASSUR DES COMMERC ET IND FR 2.125% 21-06-52	EUR	900 000	714 299,69	1,31
Automobiles			692 243,36	1,27
NISSAN MOTOR 3.201% 17-09-28	EUR	700 000	692 243,36	1,27
Banques commerciales			8 353 478,29	15,31
BARCLAYS 1.125% 22-03-31 EMTN	EUR	850 000	804 035,70	1,47
BBVA 4.875% 08-02-36 EMTN	EUR	800 000	821 505,19	1,51
CREDIT MUTUEL ARKEA 0.75% 18-01-30	EUR	700 000	599 627,72	1,10
CRELAN 5.25% 23-01-32	EUR	800 000	854 295,64	1,57
DEUTSCHE BK PARIS BRANCH 4.0% 24-06-32	EUR	700 000	683 608,68	1,25
ERSTE GR BK 1.625% 08-09-31	EUR	800 000	766 172,89	1,40
HSBC 4.599% 22-03-35	EUR	850 000	862 119,44	1,58
NATWEST GROUP 1.043% 14-09-32	EUR	950 000	863 583,87	1,58
NORDJYSKE BANK AS 5.125% 01-05-34	EUR	850 000	875 787,33	1,60
STANDARD CHARTERED 1.2% 23-09-31	EUR	950 000	886 991,64	1,63
WELLS FARGO AND 0.625% 14-08-30	EUR	400 000	335 750,19	0,62
Biens de consommation durables			1 577 669,83	2,89
ELECTROLUX AB 2.5% 18-05-30	EUR	800 000	744 763,19	1,36
NE PROPERTY BV 2.0% 20-01-30	EUR	950 000	832 906,64	1,53
Conglomérats industriels			693 719,13	1,27
3M 1.5% 02-06-31 EMTN	EUR	800 000	693 719,13	1,27
Crédit à la consommation			845 441,69	1,55
CAPITAL ONE FINANCIAL 1.65% 12-06-29	EUR	950 000	845 441,69	1,55
Distribution de produits alimentaires de première nécessité			1 299 148,08	2,38
CK HUTCHISON EUROPE FINANCE 18 2.0% 13-04-30	EUR	750 000	683 077,74	1,25
WORLDLINE 4.125% 12-09-28 EMTN	EUR	600 000	616 070,34	1,13
Equipements électriques			340 363,40	0,62
ALSTOM 0.0% 11-01-29	EUR	400 000	340 363,40	0,62

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif
FPI Soins de Santé			809 342,52	1,48
COFINIMMO 0.875% 02-12-30	EUR	1 000 000	809 342,52	1,48
Gaz			1 107 696,00	2,03
CE ENERGY AS 1.698% 30-07-26	EUR	750 000	705 574,39	1,29
NORTEGAS ENERGIA DISTRIBUCION SAU 0.905% 22-01-31	EUR	500 000	402 121,61	0,74
Gestion et promotion immobilière			666 078,60	1,22
CASTELLUM HELSINKI FINANCE 0.875% 17-09-29	EUR	800 000	666 078,60	1,22
Gestion immobilière et développement			767 379,96	1,41
KOJAMO OYJ 0.875% 28-05-29	EUR	900 000	767 379,96	1,41
Grands magasins et autres			717 986,95	1,32
PROSUS NV 2.778% 19-01-34	EUR	850 000	717 986,95	1,32
Immobilier	LOIX	030 000	871 028,48	
	EUD	4 000 000	,	1,60
VGP 2.25% 17-01-30	EUR	1 000 000	871 028,48	1,60
Logiciels			855 072,80	1,57
INTL DISTRIBUTIONS SERVICES 5.25% 14-09-28	EUR	800 000	855 072,80	1,57
Marches de capitaux			8 500 959,46	15,58
AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY FINANCING B 1.125% 11-01- 29	EUR	900 000	782 659,79	1,43
CESKA SPORITELNA AS 4.824% 15-01-30	EUR	800 000	829 958,07	1,52
DXC CAPITAL FUNDING 0.95% 15-09-31	EUR	800 000	653 004,91	1,20
EQT AB 2.875% 06-04-32	EUR	950 000	866 452,16	1,58
GOLD SACH GR 0.875% 09-05-29	EUR	300 000	264 237,41	0,48
ICPLN 2 1/2 01/28/30	EUR	800 000	712 262,15	1,31
JEFFERIES FINANCIAL GROUP 4.0% 16-04-29	EUR	700 000	701 877,04	1,29
MORGAN STANLEY 3.955% 21-03-35	EUR	750 000	753 964,34	1,38
OTP BANK 5.0% 31-01-29 EMTN	EUR	600 000	615 263,02	1,13
VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV 4.375% PERP	EUR	700 000	653 306,23	1,20
WHIRLPOOL EMEA FINANCE SARL 0.5% 20-02-28	EUR	950 000	851 577,96	1,56
WINTERSHALL DEA SCHWEIZ BV 1.332% 25-09-28	EUR	900 000	816 396,38	1,50
Media	EUD	200,000	266 594,31	0,49
JCDECAUX 1.625% 07-02-30	EUR	300 000	266 594,31	0,49
Pétrole et gaz			2 771 608,92	5,08
BP CAP MK 3.625% PERP	EUR	300 000	287 964,79	0,53
ENI 2.75% PERP	EUR	900 000	803 949,87	1,47
OMV AG 2.5% PERP	EUR	900 000	880 428,07	1,62
TOTALENERGIES SE FR 2.0% PERP	EUR	850 000	799 266,19	1,46
Produits chimiques			2 113 565,23	3,87
CELANESE US HOLDINGS LLC 0.625% 10-09-28	EUR	800 000	698 177,82	1,28
DOW CHEMICAL COMPANY 1.125% 15-03-32	EUR	800 000	664 699,43	1,22
LANXESS AG 0.625% 01-12-29	EUR	900 000	750 687,98	1,37

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Services aux professionnels			638 365,18	1,17
TELEPERFORMANCE SE 5.75% 22-11-31	EUR	600 000	638 365,18	1,17
Services clientèle divers			403 885,21	0,74
LEASYS 3.875% 01-03-28 EMTN	EUR	400 000	403 885,21	0,74
Services de télécommunication diversifiés			878 527,91	1,61
TDF INFRASTRUCTURE SAS 5.625% 21-07-28	EUR	800 000	878 527,91	1,61
Services de télécommunication mobile			600 617,77	1,10
CK HUTCHISON GROUP TELECOM FINANCE 1.5% 17-10-31	EUR	700 000	600 617,77	1,10
Services financiers diversifiés	Lort	700000	8 666 968,57	15,86
	FUD	1 000 000	·	,
AAREAL BK 0.75% 18-04-28 ADECCO INTL FINANCIAL 1.0% 21-03-82	EUR EUR	900 000	874 889,85 811 495,41	1,59 1,49
ARGENTA SPAARBANK 1.375% 08-02-29	EUR	800 000	730 670,51	1,49
BERLIN HYP AG 0.375% 21-04-31	EUR	600 000	481 173,94	0,88
BLACKSTONE HOLDINGS FINANCE CO LLC 3.5% 01-06-34	EUR	300 000	296 348,98	0,54
BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS 1.25% 26-04-27	EUR	350 000	321 944,16	0,59
CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE 1.625% 03-07-29	EUR	700 000	645 362.36	1,18
GROUPE DES ASSURANCES CREDIT MUTUEL 1.85% 21-04-42	EUR	1 000 000	812 594,73	1,49
SAGAX EURO MTN NL BV 0.75% 26-01-28	EUR	900 000	803 815,02	1,47
SANTANDER UK GROUP 0.603% 13-09-29	EUR	850 000	746 118,62	1,37
TIKEHAU CAPITAL 1.625% 31-03-29	EUR	900 000	798 230,70	1,46
UPJOHN FINANCE BV 1.908% 23-06-32	EUR	750 000	628 909,71	1,15
WPC EUROBOND BV 0.95% 01-06-30	EUR	850 000	715 414,58	1,31
Services liés aux technologies de l'information			801 090,78	1,47
TDC NET AS 6.5% 01-06-31 EMTN	EUR	750 000	801 090,78	1,47
Sociétés d'investissement immobilier cotées (SIIC)			1 560 009,49	2,86
ICADE PROMOTION 0.625% 18-01-31	EUR	1 000 000	795 382,32	1,46
UNIBAIL RODAMCO SE 2.875% PERP	EUR	800 000	764 627,17	1,40
Textiles, habillement et produits de luxe			1 022 702,78	1,87
TAPESTRY 5.875% 27-11-31	EUR	700 000	749 373,03	1,37
VF 4.25% 07-03-29 EMTN	EUR	280 000	273 329,75	0,50
TITRES D'OPC			1 153 420,32	2,11
ОРСУМ			1 153 420,32	2,11
Gestion collective			1 153 420,32	2,11
AMUNDI EURO LIQUIDITY SHORT TERM SRI PART Z C	EUR	10,967	1 153 420,32	2,11
Total		•	53 884 336,73	98,73

^(*) 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

	Valeur actuelle présentée au bilan			Montant de l'	exposition (*)
Type d'opération	Actif Passif	Devises	à recevoir (+)	Devise	es à livrer (-)	
	Actii	Passif -	Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)
Total						

^(*) 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	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.				
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total				

^(*) 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	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)	
	Nominal	Actif	Passif	+/-	
1. Futures					
EURO BOBL 0924	-223		-215 310,00	-25 966 120,00	
EURO BUND 0924	-95		-127 760,00	-12 503 900,00	
EURO SCHATZ 0924	-14		-7 910,00	-1 479 800,00	
Sous-total 1.			-350 980,00	-39 949 820,00	
2. Options					
Sous-total 2.					
3. Swaps					
Sous-total 3.					
4. Autres instruments					
Sous-total 4.					
Total			-350 980,00	-39 949 820,00	

^(*) 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.				
Total				

^(*) 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.				
Total				

^(*) 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.				
Total				

^(*) 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)	53 884 336,73
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	
Total instruments financiers à terme - actions	
Total instruments financiers à terme - taux	-350 980,00
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 (+)	1 173 556,49
Autres passifs (-)	-130 127,27
Passifs de financement (-)	
Total = actif net	54 576 785,95

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part AMUNDI FRN CREDIT EURO VALUE FACTOR-I(C)	EUR	33 200,000	1 125,2327
Part AMUNDI FRN CREDIT EURO VALUE FACTOR-12(C)	EUR	1 639,206	10 504,4405
Part AMUNDI FRN CREDIT EURO VALUE FACTOR-P(C)	EUR	1,000	115,9400

Amundi Asset Management, Société par actions Simplifiée - SAS au capital de 1 143 615 555 €.

Société de gestion de portefeuille agréée par l'AMF sous le numéro GP 04 000 036.

Sièges social : 91-93 boulevard Pasteur - 75015 Paris - France - 437 574 452 RCS Paris - www.amundi.com

