

OTHELLO

Document d'information périodique au 28/06/2024

OTHELLO

Sommaire

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR	3
NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART OU ACTION	4
ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR	5
MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR	6
DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE	7
RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR DEVISE	8
RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR SECTEUR ÉCONOMIQUE	9
RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR	10
VENTILATION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE	11
COMMISSION DE PERFORMANCE	12
INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)	13
OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE	14
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS	15
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS	16
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE	17
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT	18
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS	19
OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	20
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	21
SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE	22

OTHELLO

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR

Éléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier	1.821.778,34
b) Avoirs bancaires	4.855,64
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	25.044.334,51
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	26.870.968,49
e) Passif	-14.332,16
f) Valeur nette d'inventaire	26.856.636,33

OTHELLO

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

Code ISIN de la part	Libellé de la part	Affectation des sommes distribuables	Devise de la part	Actif net de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
FR0013425865	PART CAPI R	Capitalisable	EUR	26.856.636,33	197.361,462	136,07

OTHELLO

ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR

Eléments du portefeuille titres :	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Titres financiers éligibles et 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	6,78	6,78
b) Titres financiers éligibles et 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	0,00	0,00
c) Titres financiers éligibles et 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	0,00	0,00
d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Autres actifs	93,25	93,20

OTHELLO

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

Éléments du portefeuille titres :	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
a) Titres financiers éligibles et 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	6.672,96	0,00
b) Titres financiers éligibles et 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	0,00	0,00
c) Titres financiers éligibles et 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	0,00	0,00
d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Autres actifs	5.044.325,36	5.072.878,62

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	5.050.998,32
Cessions	5.072.878,62

OTHELLO

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Pas de distribution sur la période.

OTHELLO

RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR DEVISE

Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
		Actif net	Total des actifs
Euro	1.719.703,99	6,40	6,40
Norwegian krone	102.074,35	0,38	0,38
Total	1.821.778,34	6,78	6,78

OTHELLO

RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR SECTEUR ÉCONOMIQUE

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Electricité	6,30	6,29
ENERGIE ALTERNATIVE	0,45	0,45
	0,03	0,04
Total	6,78	6,78

OTHELLO

RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	6,40	6,40
Norvège	0,35	0,35
	0,03	0,03
Total	6,78	6,78

OTHELLO

VENTILATION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Parts d'OPC	93,25	93,20
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	72,43	72,39
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	0,00	0,00
Autres OPC et fonds d'investissements	20,82	20,81
Autres actifs	0,00	0,00
Total	93,25	93,20

OTHELLO

COMMISSION DE PERFORMANCE

PART CAPI R	28/06/2024
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance	0,00

OTHELLO

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Actions et valeurs assimilées			1.821.778,34	6,79
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			1.821.778,34	6,79
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			9.124,84	0,04
CAVENDISH HYDROGEN ASA	NOK	3.789	9.124,84	0,04
Electricité			1.691.235,28	6,30
NEOEN	EUR	44.908	1.691.235,28	6,30
ENERGIE ALTERNATIVE			121.418,22	0,45
MCPHY ENERGY	EUR	13.753	28.468,71	0,10
NEL	NOK	189.468	92.949,51	0,35
Parts d'OPC et fonds d'investissements			25.044.334,51	93,25
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne			19.452.271,02	72,43
Finance générale			2.073.433,46	7,72
AMUNDI CAC 40 ESG	EUR	16.697	2.073.433,46	7,72
Instr Invest autre que actions			13.379.119,35	49,82
ISHARES CORE EURO STOXX 50	EUR	54.410	2.731.382,00	10,17
ISHARES CORE MSCI JAPAN	EUR	23.475	1.187.271,60	4,42
ISHARES CORE S&P 500	EUR	8.999	4.874.407,34	18,15
ISHARES GLOBAL CLEAN ENERGY	EUR	104.730	759.816,15	2,83
ISHARES GLOBAL WATER	GBP	41.150	2.502.381,26	9,32
ISHARES MSCI EM ACC	EUR	36.300	1.323.861,00	4,93
OPCVM			3.448.337,24	12,84
CM-AM SHORT TERM BONDS-IC	EUR	32,53222	3.448.337,24	12,84
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne			551.380,97	2,05
CM-AM MONEPLUS-IC2	EUR	4,915	551.380,97	2,05
Autres OPC et fonds d'investissements			5.592.063,49	20,82
Autres OPC et fonds d'investissements			820.716,65	3,06
ISHARES MSCI KOREA USD ACC	USD	4.980	820.716,65	3,06
Instr Invest autre que actions			2.979.570,85	11,09
ISH.US.CORP.BD ACC.ESG ETF	USD	341.470	1.527.576,93	5,69
ISHARES DIGITALISATION	USD	172.877	1.451.993,92	5,40
OPCVM			1.791.775,99	6,67
AMUNDI S&P 500 ESG UCITS ACC	EUR	12.083	1.791.775,99	6,67
Total			26.866.112,85	100,04

OTHELLO

OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE

Libellé instrument	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)			
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)	
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)
Total	0,00	0,00		0,00		0,00

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

OTHELLO

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS

Instruments financiers à terme – actions				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

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

OTHELLO

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS

Instruments financiers à terme – taux d'intérêts				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

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

OTHELLO

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE

Instruments financiers à terme – de change				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

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

OTHELLO

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT

Instruments financiers à terme – sur risque de crédit				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

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

OTHELLO

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS

Instruments financiers à terme – autres expositions				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

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

OTHELLO

OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)

Libellé instrument	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)				Classe de part couverte
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)		
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)	
Total	0,00	0,00		0,00		0,00	

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

OTHELLO

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)

Libellé instrument	Quantité/ Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)	Classe de part couverte
		Actif	Passif	+/-	
Futures					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Options					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Swaps					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Autres instruments					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Total		0,00	0,00	0,00	

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

OTHELLO

SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	26.866.112,85
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	0,00
Total instruments financiers à terme - actions	0,00
Total instruments financiers à terme - taux	0,00
Total instruments financiers à terme - change	0,00
Total instruments financiers à terme - crédit	0,00
Total instruments financiers à terme - autres expositions	0,00
Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises	0,00
Autres actifs (+)	4.855,64
Autres passifs (-)	-14.332,16
Passifs de financement (-)	-
Total = actif net	26.856.636,33