

SOFRAGI

SOCIETE FRANÇAISE DE GESTION ET D'INVESTISSEMENT

SICAF au Capital de 3.100.000 euros

Siège Social : 37, avenue des Champs Elysées – 75008 Paris

R.C.S. PARIS B 784 337 487 – INSEE : 835.75.108.689

A.P.E. 652 E – SIRET 784 337 487 00036

COMPOSITION DE L'ACTIF et L'ACTIF NET PAR ACTION
30 juin 2017

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock administratif au 30/06/17
 PORTEFEUILLE : 00050F SOFRAGI

Devise de fixing : FXR Cours REUTERS
 Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifié, trame : PAYS-04, Tris : BVAL04)

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

0 - Actions & Valeurs assimilées

Actions & valeurs assimilées négo. sur un marché réglementé

Actions & valeurs ass. ng. sur un marché regl. ou as

PAYS EMETTEUR : BEL BELGIQUE

BE0003797140 GBL

BE0974293251 ANHE BUSC INBE SA/NV

Sous Total PAYS EMETTEUR : BEL BELGIQUE

PAYS EMETTEUR : CHE SUISSE

CH0012005267 NOVARTIS AG NOMI

CH0012214059 LAFARGEHOLCIM LTD

CH0038863350 NESTLE NOM

Sous Total PAYS EMETTEUR : CHE SUISSE

PAYS EMETTEUR : DEU ALLEMAGNE

DE0005190003 BMW

DE0005552004 DEUTSCHE POST NAMEN

DE0006483001 LINDE AG

DE0007100000 DAIMLER AG

DE0007164600 SAP SE

Sous Total PAYS EMETTEUR : DEU ALLEMAGNE

PAYS EMETTEUR : ESP ESPAGNE

ES0148396007 INDITEX

PAYS EMETTEUR : FRA FRANCE

FR0000045072 CREDIT AGRICOLE

FR0000120073 AIR LIQUIDE

FR0000120172 CARREFOUR

FR0000120271 TOTAL

FR0000120404 ACCOR

FR0000120503 BOUYGUES

FR0000120560 NEOPOST SA

FR0000120578 SANOFI

FR0000120628 AXA

FR0000120644 DANONE

FR0000120693 PERNOD-RICARD

FR0000121261 MICHELIN CAT. B

FR0000121972 SCHNEIDER ELECT SE

FR0000125007 SAINT-GOBAIN

FR0000125338 CAPGEMINI

FR0000125346 INGENICO

FR0000125684 ZODIAC AEROSPACE

FR0000130577 PUBLICIS GROUPE SA

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock administratif au 30/06/17
 PORTEFEUILLE : 000SOF SOFRAGI

Devise de fixing : FXR Cours REUTERS
 Devise du portefeuille : EUR
 (Etat simplifié, trame : PAYS-04, Tris : BVAL04)

V	A	L	E	U	R	STATUTS	DOSSIER	VAL/LIGNE	QUANTITE ET	DEV	P.R.U EN	DEVISE	DATE	COURS	VALEUR	F	PRIX	REVIEMT	TOTA	VALEUR	BOURSIERE	COUPON	COURU	TOTA	PLUS OU	MOINS	VAL	ACT	NET	PRCT
----->																														
-----<																														
Sous Total PAYS EMETTEUR : FRA FRANCE																														
FR0000130809	SOCIETE	GENERALE	SA						75,000.	P	EUR	M	30/06/17	47.11	T	2,772,810.91			0.00	3,533,250.00				0.00	0.00	760,439.09	1.73			
FR0000131104	BNP	PARIBAS						50,000.	P	EUR	M	30/06/17	63.06	T	2,513,719.93			0.00	3,153,000.00				0.00	0.00	639,280.07	1.55				
FR0000133308	ORANGE							155,000.	P	EUR	M	30/06/17	13.89	T	2,243,968.44			0.00	2,152,950.00				0.00	0.00	-91,018.44	1.06				
FR0006174348	BUREAU	VERITAS						105,000.	P	EUR	M	30/06/17	19.375	T	2,135,828.25			0.00	2,034,375.00				0.00	0.00	-101,453.25	1.00				
FR0010221234	EUTELSAT	COMMUNICA						101,308.	P	EUR	M	30/06/17	22.36	T	2,307,056.69			0.00	2,265,246.88				0.00	0.00	-41,809.81	1.11				
FR0010386334	Korlian	SA						55,000.	P	EUR	M	30/06/17	29.875	T	1,714,736.67			0.00	1,643,125.00				0.00	0.00	-71,611.67	0.81				
FR0010451203	REXEL							70,000.	P	EUR	M	30/06/17	14.325	T	1,005,427.43			0.00	1,002,750.00				0.00	0.00	-2,677.43	0.49				
FR0011950732	ELIOR	GROUP	SCA					53,500.	P	EUR	M	30/06/17	25.44	T	1,036,131.18			0.00	1,361,040.00				0.00	0.00	324,908.82	0.67				
FR0013176526	VALEO							21,500.	P	EUR	M	30/06/17	58.99	T	1,303,156.44			0.00	1,268,285.00				0.00	0.00	-34,871.44	0.62				
XFC500X01L11	SOFRAGI	PROV						492.	P	EUR	M	30/06/17	1632.98	T	752,905.52			0.00	803,426.16				0.00	0.00	50,520.64	0.39				
Sous Total PAYS EMETTEUR : GBR ROYAUME UNI																														
GB0001411924	BRITISH	SKY	BROAD.					100,000.	P	GBP	M	30/06/17	9.94	T	960,614.92			0.00	1,132,053.98				0.00	0.00	171,439.06	0.56				
GB0009252882	GLAXOSMI	THKLINE	PLC					75,000.	P	GBP	M	30/06/17	16.355	T	1,330,669.60			0.00	1,396,987.64				0.00	0.00	66,318.04	0.68				
GB00083MLX29	ROYA	DUTC	SHEL	PLC				100,000.	P	EUR	M	30/06/17	23.235	T	2,420,472.39			0.00	2,323,500.00				0.00	0.00	-96,972.39	1.14				
GB000BDSFG982	TECHNIP	PFMC	LIMITED					54,000.	P	EUR	M	30/06/17	23.745	T	1,397,976.63			0.00	1,282,230.00				0.00	0.00	-115,746.63	0.63				
Sous Total PAYS EMETTEUR : ISR ISRAEL																														
IL0007670123	ISRAEL	PHOENIX						47,000.	P	ILS	M	29/06/17	14.84	T	137,057.93			0.00	175,237.43				0.00	0.00	38,179.50	0.09				
Sous Total PAYS EMETTEUR : ITA ITALIE																														
IT0000062072	ASSICURAZ.	GENERALI						75,000.	P	EUR	M	30/06/17	14.41	T	970,649.07			0.00	1,080,750.00				0.00	0.00	110,100.93	0.53				
IT0001389631	BENI	STABILI	SPA					1,450,000.	P	EUR	M	30/06/17	0.632	T	731,535.39			0.00	916,400.00				0.00	0.00	184,864.61	0.45				
IT0001479374	LUXOTTICA	GROUP						32,000.	P	EUR	M	30/06/17	50.65	T	1,512,206.85			0.00	1,620,800.00				0.00	0.00	108,593.15	0.79				
Sous Total PAYS EMETTEUR : JEU JERSEY																														
JE00B20KY057	SHIRE							53,000.	P	GBP	M	30/06/17	42.38	T	2,854,802.72			0.00	2,558,100.34				0.00	0.00	-296,702.38	1.25				
JE00B8KF9B49	WPP	PLC						152,000.	P	GBP	M	30/06/17	16.14	T	3,009,047.64			0.00	2,794,009.45				0.00	0.00	-215,038.19	1.37				
JE00BDS9R069	UBM	PLC						1.	P	GBP	M	30/06/17	6.9	T	7.14			0.00	7.86				0.00	0.00	0.72	0.00				
Sous Total PAYS EMETTEUR : LUX LUXEMBOURG																														
LU1598757687	ARCELORMIT	ITAL						111,000.	P	EUR	M	30/06/17	19.86	T	1,997,425.89			0.00	2,204,460.00				0.00	0.00	207,034.11	1.08				
Sous Total PAYS EMETTEUR : NLD PAYS-BAS																														
NL0000395937	WORLD	ONLINE	INTL					4,000.	P	EUR	M	30/06/17	52.55	T	0.00			0.00	0.00				0.00	0.00	0.00	0.00				
NL0000400653	GEMALTO							36,000.	P	EUR	M	30/06/17	52.55	T	2,019,128.12			0.00	1,891,800.00				0.00	0.00	-127,328.12	0.93				
Sous Total PAYS EMETTEUR : NOR NORVEGE																														
Sous Total PAYS EMETTEUR : NOR NORVEGE																														

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock administratif au 30/06/17
 PORTEFEUILLE : 000SOF SOFRAGI

Devise de fixing : FXR Cours REUTERS
 Devise du portefeuille : EUR
 (Etat simplifié, trame : PAYS-04, Tris : BVAL04)

VL VALIDEE

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 <----->	VALEUR BOURSIERE COUPON COURRU TOTA	Devise du portefeuille PLUS OU MOINS VAL ACT NET	PRCT ACT NET	
US85771P1021	STATO1LHYDRO ADR		200,000.	P USD	16.5093	M 30/06/17	16.53	T	2,980,901.41	2,898,601.55	0.00	-82,299.86	1.42
PAYS EMETTEUR : USA ETATS UNIS AMERIQUE													
US1508701034	CELANESE SER A		15,000.	P USD	88.1324	M 30/06/17	94.94	T	1,182,033.69	1,248,608.13	0.00	66,574.44	0.61
US1101221083	BRI STOL MYERS SQUIB		37,000.	P USD	61.781	M 30/06/17	55.72	T	2,057,143.82	1,807,584.06	0.00	-249,559.76	0.89
US68389X1054	ORACLE CORP		52,000.	P USD	38.76	M 30/06/17	50.14	T	1,598,791.89	2,285,984.83	0.00	687,192.94	1.12
US7170811035	PFIZER INC		37,000.	P USD	32.4825	M 30/06/17	33.59	T	1,098,885.13	1,089,676.03	0.00	-9,209.10	0.53
US74005P1049	PRAXAIR		16,400.	P USD	118.6769	M 30/06/17	132.55	T	1,810,095.01	1,905,940.12	0.00	95,845.11	0.93
Sous Total PAYS EMETTEUR : USA ETATS UNIS AMERIQUE													
						CUMUL (EUR)			7,746,949.54	8,337,793.17	0.00	590,843.63	4.09
Actions&valeurs ass. ng. sur un marché regl. ou as													
						CUMUL (EUR)			111,390,107.39	122,496,329.48	0.00	11,106,222.09	60.06
Bons de souscriptions neg sur marché regl													
PAYS EMETTEUR : FRA FRANCE													
FR0013255023	PUBL GROU RTS 06-17		42,620.	P EUR	0.	M		A	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
FR0013256864	CARR SA RTS 07-17		95,500.	P EUR	0.	M		A	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
FR0013258670	KORIAN SA RTS 07-17		55,000.	P EUR	0.	M		A	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Sous Total PAYS EMETTEUR : FRA FRANCE													
						CUMUL (EUR)			0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
Actions & valeurs assimilées négo. sur un marché réglementé													
						CUMUL (EUR)			111,390,107.39	122,496,329.48	0.00	11,106,222.09	60.06
I - Obligations & Valeurs assimilées													
Obligations & valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé													
Obligations à taux fixe négo. sur un marché regl.													
PAYS EMETTEUR : BEL BELGIQUE													
BE6248510610	KBC BANK 8% 01/23	(USA) 250123	2,600,000.	M USD	106.3622	% 30/06/17	103.118	4	2,593,534.12	2,431,225.87	80,545.94	-162,308.25	1.19
PAYS EMETTEUR : FRA FRANCE													
FR0010531012	NATIXIS 6.307% PERP	(366) 311299	2,500,000.	M EUR	106.2599	% 30/06/17	101.838	4	2,656,496.60	2,657,834.45	111,884.45	1,337.85	1.30
FR0010535971	BPCE TF/TV PERP	(366) 311299	4,000,000.	M EUR	106.06	% 30/06/17	102.169	4	4,242,398.70	4,252,337.97	165,577.97	9,939.27	2.08
FR0010814434	CA TF/TV 26/10/59	(366) 311299	2,600,000.	M EUR	121.0219	% 30/06/17	116.15	4	3,146,569.87	3,160,700.68	140,800.68	14,130.81	1.55
FR0010815464	GROUPA 7.875% 271039	(366) 271039	800,000.	M EUR	106.0988	% 30/06/17	114.972	4	848,790.44	962,926.68	43,150.68	114,136.24	0.47
FR0011606169	CASINO 4.87 PERP	(EXA) 311299	900,000.	M EUR	99.9302	% 30/06/17	101.515	4	899,371.73	932,127.66	18,492.66	32,755.93	0.46
FR0012005924	ACCOR SA 4.13 PERP	(366) 311299	2,000,000.	M EUR	109.7716	% 30/06/17	105.795	4	2,195,432.00	2,116,804.11	904.11	-78,627.89	1.04
FR0012278539	AKEFF 4 3/4 10/29/49	(EXA) 311299	1,500,000.	M EUR	111.4911	% 30/06/17	108.425	4	1,672,366.43	1,674,785.96	48,410.96	2,419.53	0.82
XS0449487619	SOC GEN TF/TV PERP	(366) 311299	2,100,000.	M EUR	125.2412	% 30/06/17	118.176	4	2,630,065.87	2,645,129.22	163,433.22	15,063.35	1.30
XS1195201931	TOTAL SA 2.25 PERP	(366) 311299	2,500,000.	M EUR	101.8897	% 30/06/17	101.377	4	2,547,243.15	2,554,151.03	19,726.03	6,907.88	1.25
Sous Total PAYS EMETTEUR : FRA FRANCE													
						CUMUL (EUR)			20,838,734.79	20,956,797.76	712,380.76	118,062.97	10.28
PAYS EMETTEUR : GBR ROYAUME UNI													
XS0873630742	PRUDENTIAL 5.25% 49	(EUR) 311299	3,718,000.	M USD	103.0606	% 30/06/17	100.707	4	3,525,431.23	3,288,107.10	5,229.31	-237,324.13	1.61

Inventaire sur historique de valorisation (HISIMV)

Stock : Stock administratif principal au 30/06/17
 PORTEFEUILLE : 000SOF SOFRAGI

Devise de fixing : FXR Cours REUTERS
 Devise du portefeuille : EUR
 (Etat simplifié, trame : PAYS-04, Tris : BVALD4)

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	COURON COURTOTA	PLUS OU MOINS VAL ACT NET	PRCT
PAYS EMETTEUR : IRL IRLANDE													
XS0733071632	CLOW PLC 8.25 PERP	(EUR) 311299	500,000.	M USD	107.4458	% 30/06/17	103.161	4	489,547.25	459,877.54	7,635.20	-29,669.71	0.23
PAYS EMETTEUR : LUX LUXEMBOURG													
XS1224953882	EURO SCI 4.88 PERP	(366) 311299	506,000.	M EUR	106.4167	% 30/06/17	107.163	4	538,468.25	546,705.20	4,460.42	8,236.95	0.27
XS1405777746	SOCI EUR 4.63 PERP	(366) 311299	1,800,000.	M EUR	100.2769	% 30/06/17	107.529	4	1,804,984.20	1,977,261.04	41,739.04	172,276.84	0.97
Sous Total PAYS EMETTEUR : LUX LUXEMBOURG													
						CUMUL (EUR)			2,343,452.45	2,523,966.24	46,199.46	180,513.79	1.24
PAYS EMETTEUR : NLD PAYS-BAS													
XS0827817650	ABN AMRO BK 6.25% 22	(USA) 130922	2,800,000.	M USD	104.3825	% 30/06/17	100.846	4	2,683,745.78	2,523,033.91	47,309.04	-160,711.87	1.24
XS0903872355	KON KPN 6.125% 09/19	(366) 311299	2,000,000.	M EUR	111.3	% 30/06/17	106.352	4	2,226,000.00	2,225,375.62	98,335.62	-624.38	1.09
Sous Total PAYS EMETTEUR : NLD PAYS-BAS													
						CUMUL (EUR)			4,909,745.78	4,748,409.53	145,644.66	-161,336.25	2.33
Obligations à taux fixe négo. sur un marché régi.													
Obligations convertibles négo. sur un marché régi.													
PAYS EMETTEUR : ESP ESPAGNE													
XS1500463358	INDR SI 1.25 10-23	(UST) 071023	2,100,000.	M EUR	100.	% 30/06/17	108.189	4	2,100,000.00	2,278,280.48	6,311.48	178,280.48	1.12
PAYS EMETTEUR : FRA FRANCE													
FR0011534874	ORPEA 1.75% 01/20 CV	(UST) 010120	20,000.	P EUR	49.6683	M 30/06/17	103.304	4	993,365.38	2,066,080.00	8,102.98	1,072,714.62	1.01
FR0011567908	RALLYE 1% 02/10/20	(366) 021020	21,000.	P EUR	99.3929	M 30/06/17	105.051	4	2,087,250.00	2,206,071.00	15,446.78	118,821.00	1.08
FR0012799229	NEOP FRA 3.375 PERP	(UST) 311299	18,000.	P EUR	45.1556	M 30/06/17	61.18	4	812,800.00	1,101,240.00	1,342.44	288,440.00	0.54
FR0013044286	BNM 2.5% 13-11-20 CV	(366) 131120	60,000.	P EUR	28.1	M 30/06/17	28.657	4	1,686,000.00	1,719,512.55	21,286.03	33,512.55	0.84
FR0013134681	VEOL ENVI ZCP 03-21	(999) 150321	32,000.	P EUR	29.95	M 30/06/17	29.743	4	958,400.00	951,776.00	0.00	-6,624.00	0.47
Sous Total PAYS EMETTEUR : FRA FRANCE													
						CUMUL (EUR)			6,537,815.38	8,044,679.55	46,178.23	1,506,864.17	3.94
PAYS EMETTEUR : LUX LUXEMBOURG													
XS0272723551	OPUS SECU FLR PERP	(999) 311299	925,000.	M EUR	86.8973	% 30/06/17	94.317	4	803,799.58	877,030.45	4,598.20	73,230.87	0.43
PAYS EMETTEUR : NLD PAYS-BAS													
XS1046477581	AGEN 0 7/8 03/19/21	(360) 190321	4,000,000.	M USD	103.2758	% 30/06/17	128.398	4	3,050,705.08	4,511,970.83	8,950.36	1,461,265.75	2.21
Obligations convertibles négo. sur un marché régi.													
						CUMUL (EUR)			12,492,320.04	15,711,961.31	66,038.27	3,219,641.27	7.70
Obligations & valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé													
						CUMUL (EUR)			47,192,765.66	50,120,345.35	1,063,673.60	2,927,579.69	24.57

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock administratif au 30/06/17
 PORTEFEUILLE : 00050F SOFRAGI

Devise de fixing : FXR Cours REUTERS
 Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifié, trame : PAYS-04, Tris : BVAL04)

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	F	PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURTO	TOTA	PLUS OU MOINS VAL ACT NET	PRCT	
																			----->	
																			Devise du portefeuille	
III - Titres d'OPCVM																				
OPCVM français à vocation générale																				
PAYS EMETTEUR : FRA FRANCE																				
FR0000285462								75.	P EUR	1524.4901	M 30/06/17	5830.83	5	114.336.76	437,312.25		0.00	322,975.49	0.21	
FR0000287716								326.	P EUR	23289.1656	M 29/06/17	23288.9812	0	7,592,267.99	7,592,207.87		0.00	-60.12	3.72	
Sous Total PAYS EMETTEUR : FRA FRANCE																			322,915.37	3.94
OPCVM européens coordonnés et assimilables																				
PAYS EMETTEUR : LUX LUXEMBOURG																				
LU0325598752								125,000.	P EUR	112.9771	M 29/06/17	113.44	0	14,122,132.35	14,180,000.00		0.00	57,867.65	6.95	
Sous Total PAYS EMETTEUR : LUX LUXEMBOURG																			380,783.02	10.89
III - Titres d'OPCVM																				
VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHES A TERME																				
Engagements à terme fermes																				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé																				
IVG___U7								-384.	EUR	3560.	M 30/06/17	3431.	4	0.00	495,360.00		0.00	495,360.00	0.24	
Sous Total PAYS EMETTEUR : LUX LUXEMBOURG																			495,360.00	0.24
VIII - TRESORERIE																				
Dettes et créances																				
Règlements différés																				
ARDEUR								-3,948,143.56	EUR	1.		1.		-3,948,143.56			0.00	0.00	-1.94	
VRDCHF								588,027.01	CHF	0.9146202		0.9155413		537,821.38	538,363.02		0.00	541.64	0.26	
VRDEUR								1,688,735.37	EUR	1.		1.		1,688,735.37	1,688,735.37		0.00	0.00	0.83	
Sous Total Règlements différés																			-1,721,586.81	-0.84
Coupons et dividendes																				
FR0000120172								95,500.	P EUR	0.7	30/06/17			66,850.00	66,850.00		0.00	0.00	0.03	
FR0000130577								42,620.	P EUR	1.85	30/06/17			78,847.00	78,847.00		0.00	0.00	0.04	
FR0010386334								55,000.	P EUR	0.6	30/06/17			33,000.00	33,000.00		0.00	0.00	0.02	
GB0009252882								75,000.	P GBP	0.19	30/06/17			16,229.14	16,229.14		0.00	-747.27	0.01	
JE0088KF9849								152,000.	P GBP	0.3705	30/06/17			64,137.58	64,137.58		0.00	-839.92	0.03	
Sous Total Règlements différés																			-1,721,586.81	-0.84
Coupons et dividendes																				
FR0000120172								95,500.	P EUR	0.7	30/06/17			66,850.00	66,850.00		0.00	0.00	0.03	
FR0000130577								42,620.	P EUR	1.85	30/06/17			78,847.00	78,847.00		0.00	0.00	0.04	
FR0010386334								55,000.	P EUR	0.6	30/06/17			33,000.00	33,000.00		0.00	0.00	0.02	
GB0009252882								75,000.	P GBP	0.19	30/06/17			16,229.14	16,229.14		0.00	-747.27	0.01	
JE0088KF9849								152,000.	P GBP	0.3705	30/06/17			64,137.58	64,137.58		0.00	-839.92	0.03	
Sous Total Règlements différés																			-1,721,586.81	-0.84
Coupons et dividendes																				
FR0000120172								95,500.	P EUR	0.7	30/06/17			66,850.00	66,850.00		0.00	0.00	0.03	
FR0000130577								42,620.	P EUR	1.85	30/06/17			78,847.00	78,847.00		0.00	0.00	0.04	
FR0010386334								55,000.	P EUR	0.6	30/06/17			33,000.00	33,000.00		0.00	0.00	0.02	
GB0009252882								75,000.	P GBP	0.19	30/06/17			16,229.14	16,229.14		0.00	-747.27	0.01	
JE0088KF9849								152,000.	P GBP	0.3705	30/06/17			64,137.58	64,137.58		0.00	-839.92	0.03	
Sous Total Règlements différés																			-1,721,586.81	-0.84
Coupons et dividendes																				
FR0000120172								95,500.	P EUR	0.7	30/06/17			66,850.00	66,850.00		0.00	0.00	0.03	
FR0000130577								42,620.	P EUR	1.85	30/06/17			78,847.00	78,847.00		0.00	0.00	0.04	
FR0010386334								55,000.	P EUR	0.6	30/06/17			33,000.00	33,000.00		0.00	0.00	0.02	
GB0009252882								75,000.	P GBP	0.19	30/06/17			16,229.14	16,229.14		0.00	-747.27	0.01	
JE0088KF9849								152,000.	P GBP	0.3705	30/06/17			64,137.58	64,137.58		0.00	-839.92	0.03	
Sous Total Règlements différés																			-1,721,586.81	-0.84
Coupons et dividendes																				
FR0000120172								95,500.	P EUR	0.7	30/06/17			66,850.00	66,850.00		0.00	0.00	0.03	
FR0000130577								42,620.	P EUR	1.85	30/06/17			78,847.00	78,847.00		0.00	0.00	0.04	
FR0010386334								55,000.	P EUR	0.6	30/06/17			33,000.00	33,000.00		0.00	0.00	0.02	
GB0009252882								75,000.	P GBP	0.19	30/06/17			16,229.14	16,229.14		0.00	-747.27	0.01	
JE0088KF9849								152,000.	P GBP	0.3705	30/06/17			64,137.58	64,137.58		0.00	-839.92	0.03	
Sous Total Règlements différés																			-1,721,586.81	-0.84
Coupons et dividendes																				
FR0000120172								95,500.	P EUR	0.7	30/06/17			66,850.00	66,850.00		0.00	0.00	0.03	
FR0000130577								42,620.	P EUR	1.85	30/06/17			78,847.00	78,847.00		0.00	0.00	0.04	
FR0010386334								55,000.	P EUR	0.6	30/06/17			33,000.00	33,000.00		0.00	0.00	0.02	
GB0009252882								75,000.	P GBP	0.19	30/06/17			16,229.14	16,229.14		0.00	-747.27	0.01	
JE0088KF9849								152,000.	P GBP	0.3705	30/06/17			64,137.58	64,137.58		0.00	-839.92	0.03	
Sous Total Règlements différés																			-1,721,586.81	-0.84
Coupons et dividendes																				
FR0000120172								95,500.	P EUR	0.7	30/06/17			66,850.00	66,850.00		0.00	0.00	0.03	
FR0000130577								42,620.	P EUR	1.85	30/06/17			78,847.00	78,847.00		0.00	0.00	0.04	
FR0010386334								55,000.	P EUR	0.6	30/06/17			33,000.00	33,000.00		0.00	0.00	0.02	
GB0009252882								75,000.	P GBP	0.19	30/06/17			16,229.14	16,229.14		0.00	-747.27	0.01	
JE0088KF9849								152,000.	P GBP	0.3705	30/06/17			64,137.58	64,137.58		0.00	-839.92	0.03	
Sous Total Règlements différés																			-1,721,586.81	-0.84
Coupons et dividendes																				
FR0000120172								95,500.	P EUR	0.7	30/06/17			66,850.00	66,850.00		0.00	0.00	0.03	
FR0000130577								42,620.	P EUR	1.85	30/06/17			78,847.00	78,847.00		0.00	0.00	0.04	
FR0010386334								55,000.	P EUR	0.6	30/06/17			33,000.00	33,000.00		0.00	0.00	0.02	
GB0009252882								75,000.	P GBP	0.19	30/06/17			16,229.14	16,229.14		0.00	-747.27	0.01	
JE0088KF9849								152,000.	P GBP	0.3705	30/06/17			64,137.58	64,137.58		0.00	-839.92	0.03	
Sous Total Règlements différés																			-1,721,586.81	-0.84
Coupons et dividendes																				
FR0000120172								95,500.	P EUR	0.7	30/06/17			66,850.00	66,850.00		0.00	0.00	0.03	
FR0000130577								42,620.	P EUR	1.85	30/06/17			78,847.00	78,847.00		0.00	0.00	0.04	
FR0010386334								55,000.	P EUR	0.6	30/06/17			33,000.00	33,000.00		0.00	0.00	0.02	
GB0009252882								75,000.	P GBP	0.19	30/06/17			16,229.14	16,229.14		0.00	-747.27	0.01	
JE0088KF9849								152,000.	P GBP	0.3705	30/06/17			64,137.58	64,137.58		0.00	-839.92	0.03	
Sous Total Règlements différés																			-1,721,586.81	-0.84
Coupons et dividendes																				
FR0000120172								95,500.	P EUR	0.7	30/06/17			66,850.00	66,850.00		0.00	0.00	0.03	
FR0000130577								42,620.	P EUR	1.85	30/06/17			78,847.00	78,847.00		0.00	0.00	0.04	
FR0010386334								55,000.	P EUR	0.6	30/06/17			33,000.00	33,000.00		0.00	0.00	0.02	
GB0009252882								75,000.	P GBP	0.19	30/06/17			16,229.14	16,229.14		0.00	-747.27	0.01	
JE0088KF9849								152,000.	P GBP	0.3705	30/06/17			64,137.58	64,137.58		0.00	-839.92	0.03	
Sous Total Règlements différés																			-1,721,586.81	-0.84
Coupons et dividendes																				
FR0000120172								95,500.	P EUR	0.7	30/06/17			66,850.00	66,850.					

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock administratif au 30/06/17
 PORTEFEUILLE : 000SOF SOFRAGI

Devise de fixing : FXR Cours REUTERS
 Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifié, trame : PAYS-04, Tris : BVAL04)

VL VALIDEE

V	A	L	E	U	R	STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P. R. U EN DEVISE	DATE	COURS	I	F	PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURRU TOTA	PLUS OU MOINS VAL ACT NET	PRCT	
						VAL/LIGNE		EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR. COURS	COTA	VALEUR			<-----			----->		
Appels de marge																				
MARCEUR								-495,360.	EUR	1.		1.			-495,360.00	-495,360.00	0.00	0.00	-0.24	
Appels marges C.A.I.																				
Frais de gestion																				
FGPVFEUR								-319,659.84	EUR	1.		1.			-319,659.84	-319,659.84	0.00	0.00	-0.16	
Frais de Gest. Fixe																				
Dettes et créances Immobilières																				
AUTCREDEUR								-3,996.43	EUR	1.		1.			-3,996.43	-3,996.43	0.00	0.00	0.00	
Autres créditeurs																				
Dettes et créances																				
															CUMUL (EUR)		-1,308,745.52	0.00	-1,045.55	-0.64
Disponibilités																				
Avoits																				
BOCIAUD					AUD			1,010,689.34		0.69989588		0.6725401			707,377.31	679,729.19	0.00	0.00	0.33	
BOCICAD					CAD			143,244.74		0.76490383		0.6751054			109,568.45	96,705.31	0.00	0.00	0.05	
BOCICHF					CHF			830,482.1		0.93289753		0.9155413			774,754.70	760,340.67	0.00	0.00	0.37	
BOCIDKK					DKK			56,885.69		0.13405867		0.1344980			7,626.02	7,651.02	0.00	0.00	0.00	
BOCIEUR					EUR			2,888,669.23		1.		1.			2,888,669.23	2,888,669.23	0.00	0.00	1.42	
BOCIGBP					GBP			542,854.58		1.14253071		1.1388873			620,228.03	618,250.19	0.00	0.00	0.30	
BOCII LS					ILS			145,360.03		0.1968363		0.2512436			28,612.13	36,520.79	0.00	0.00	0.02	
BOCIIJPY					JPY			2,362,175.		0.00631319		0.0078032			14,912.86	18,432.57	0.00	0.00	0.01	
BOCINOK					NOK			15,829.33		0.13190577		0.1046682			2,087.98	1,656.83	0.00	0.00	0.00	
BOCISEK					SEK			16,140.29		0.11128982		0.1039501			1,796.25	1,677.78	0.00	0.00	0.00	
BOCIUSD					USD			5,509,063.06		0.89820753		0.8767699			4,948,281.95	4,830,181.11	0.00	0.00	2.37	
															CUMUL (EUR)		10,103,914.91	0.00	-164,100.22	4.87
VIII - TRESORERIE																				
															CUMUL (EUR)		8,796,214.94	0.00	-165,145.77	4.23
PORTFEUILLE : SOFRAGI (000SOF)																				
															(EUR)		189,207,825.09	1,063,673.60	14,744,799.03	100.00
															(EUR)		203,952,624.12			

Inventaire sur historique de valorisation (HISIMV)

Stock : Stock adm_i_principal au 30/06/17
 PORTEFEUILLE : 000SOF SOFRAGI

VL VALIDEE
 Devise de fixing : FXR Cours REUTERS
 Devise du portefeuille : EUR
 (Etat simplifie, trame : PAYS-04, Tris : BVAL04)

		COURS DES DEVICES UTILISEES				
		par la valorisation	par l'inventaire	par la valorisation précédente	variation	
Cours	EUR en AUD :	1.4869	0.	1.488	cotation : 29/06/17	-0.07392
Cours	EUR en CAD :	1.48125	0.	1.4842	cotation : 29/06/17	-0.19876
Cours	EUR en CHF :	1.09225	0.	1.09335	cotation : 29/06/17	-0.10061
Cours	EUR en DKK :	7.43505	0.	7.4362	cotation : 29/06/17	-0.01546
Cours	EUR en GBP :	0.87805	0.	0.87915	cotation : 29/06/17	-0.12512
Cours	EUR en ILS :	3.9802	0.	3.98385	cotation : 29/06/17	-0.09162
Cours	EUR en JPY :	128.1522	0.	128.65095	cotation : 29/06/17	-0.38768
Cours	EUR en NOK :	9.554	0.	9.58775	cotation : 29/06/17	-0.35201
Cours	EUR en SEK :	9.62	0.	9.6905	cotation : 29/06/17	-0.72752
Cours	EUR en USD :	1.14055	0.	1.14265	cotation : 29/06/17	-0.18378

		COURS INVERSES DES DEVICES UTILISEES				
		par la valorisation	par l'inventaire	par la valorisation précédente		
Cours	AUD en EUR :	0.6725401842	0.	0.6720430107	cotation : 29/06/17	
Cours	CAD en EUR :	0.6751054852	0.	0.6737636437	cotation : 29/06/17	
Cours	CHF en EUR :	0.9155413138	0.	0.9146202039	cotation : 29/06/17	
Cours	DKK en EUR :	0.1344980867	0.	0.134472867	cotation : 29/06/17	
Cours	GBP en EUR :	1.1388873071	0.	1.1374623215	cotation : 29/06/17	
Cours	ILS en EUR :	0.251243656	0.	0.2510134668	cotation : 29/06/17	
Cours	JPY en EUR :	0.0078032214	0.	0.0077729701	cotation : 29/06/17	
Cours	NOK en EUR :	0.104682018	0.	0.1042997575	cotation : 29/06/17	
Cours	SEK en EUR :	0.1039501039	0.	0.1031938496	cotation : 29/06/17	
Cours	USD en EUR :	0.8767699793	0.	0.8751586225	cotation : 29/06/17	