

INFORMATIONS
SEMESTRIELLES
JUN 2024

AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR

FCPE – Fonds d'Epargne Salariale de droit français

Société de Gestion

Amundi Asset Management

Sous déléguataire de gestion comptable en titre

Caceis Fund Administration

Dépositaire

CACEIS BANK

Commissaire aux Comptes

DELOITTE & ASSOCIÉS

AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR

FCPE - Fonds d'épargne salariale

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. 214-24-55 du code monétaire et financier	34 849 513,45
b) Avoirs bancaires	247 605,84
c) Autres actifs détenus par l'OPC	252 937 375,62
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	288 034 494,91
e) Passif	-1 139 043,84
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	286 895 451,07

(*) 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 HORIZON LONG TERME ESR ASSUREUR en EUR	C	3 358 440,82	35 831,7607	93,72
AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR E en EUR	C	2 412 428,29	26 115,7099	92,37
AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR F en EUR	C	251 854 590,87	2 668 911,3354	94,36
AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR PER en EUR	C	29 269 991,09	310 506,5702	94,26

AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR

FCPE - Fonds d'épargne salariale

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. 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.	8,17	8,14
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.	3,98	3,96
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.	84,50	84,16

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

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

AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR

FCPE - Fonds d'épargne salariale

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	23 823 873,22	8,30	8,27
Dollar Us	USD	11 025 640,23	3,84	3,83
TOTAL		34 849 513,45	12,15	12,10

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

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

AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR

FCPE - Fonds d'épargne salariale

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 (**)
ETATS-UNIS	3,84	3,83
ESPAGNE	3,57	3,56
FRANCE	2,24	2,23
ALLEMAGNE	1,48	1,47
LUXEMBOURG	0,58	0,58
PORTUGAL	0,29	0,29
HONG-KONG	0,13	0,13
TOTAL	12,15	12,10

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

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

AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR

FCPE - Fonds d'épargne salariale

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	83,01	82,68
Autres OPC et fonds d'investissements		
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	1,49	1,48
Autres		
TOTAL	84,50	84,16

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

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

AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR

FCPE - Fonds d'épargne salariale

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. 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.	17 298 786,28	6 981 733,83
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.	128 133 761,14	95 284 225,60

AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR

FCPE - Fonds d'épargne salariale

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
OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES			34 849 513,45	12,15
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			34 849 513,45	12,15
Banques commerciales			386 785,95	0,13
HONG KONG MONETARY AUTHORITY HONG 3.875% 11-01-25	EUR	380 000	386 785,95	0,13
Marches de capitaux			1 677 192,66	0,58
AMUNDI REAL ASSETS COMPANY AUTRE V 26-01-50	EUR	1 700 000	1 677 192,66	0,58
Services aux collectivités			32 785 534,84	11,44
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0.0% 15-08-50	EUR	480 000	242 527,20	0,08
DBR 0 08/15/30	EUR	4 627 669,27	4 005 108,92	1,40
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.1% 01-03-25	EUR	5 500 000	6 430 043,03	2,24
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 2.25% 18-04-34	EUR	900 000	835 498,54	0,29
SPAIN GOVERNMENT BOND 3.25% 30-04-34	EUR	10 300 000	10 246 716,92	3,59
UNITED STATES TREAS INFLATION BONDS 0.125% 15-07-30	USD	7 600 000	7 754 883,42	2,70
UNITED STATES TREAS INFLATION BONDS 0.125% 15-10-25	USD	3 000 000	3 270 756,81	1,14
TITRES D'OPC			242 414 576,60	84,49
OPCVM			238 153 505,02	83,00
Gestion collective			238 153 505,02	83,00
AMUNDI EURO LIQUIDITY-RATED SRI Part Z	EUR	9,042	9 534 432,74	3,32
AMUNDI EURO LIQUIDITY SHORT TERM SRI PART Z C	EUR	29,72	3 125 709,11	1,09
AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI PART Z C	EUR	17,752	18 724 750,64	6,53
AMUNDI FUNDS EMERGING MARKETS LOCAL CURRENCY BOND Z EUR AD D	EUR	3 722,9	2 879 998,21	1,00
AMUNDI FUNDS EURO HIGH YIELD SHORT TERM BOND X EUR	EUR	10 240,812	11 424 240,23	3,98
AMUNDI GLOB EMER BD MARKITIBOXXUCETFUS C	USD	69 012	8 701 918,99	3,03
AMUNDI INDEX BARCLA EUR CO BBB1-5UCETFDR	EUR	433 940	22 296 054,17	7,77
AMUNDI INDEX BARC US CO BBB1-5UCITS ETF DR	USD	417 519	21 924 198,31	7,64
AMUNDI INDEX EURO AGG CORPORATE SRI - UCITS ETF DR (C)	EUR	1 019 189	51 405 854,78	17,93
AMUNDI INDEX US CORP SRI - UCITS ETF DR C	USD	382 619	20 321 022,72	7,08
AMUNDI MSCI WORLD UCITS ETF DR USD ACC	EUR	161 411	19 291 842,72	6,72
AMUNDI PLANET II SEED SENIOR EUR HDG D	EUR	200	2 012 306,00	0,70
BFT AUREUS ISR PART Z C	EUR	58,636	6 185 693,70	2,16
BFT SELECTION RENDEM 2026 I2	EUR	4 109,532	4 304 338,61	1,50
CPR MONETAIRE ISR Z FCP	EUR	127,922	2 699 514,94	0,94
iShares China CNY Bond UCITS ETF USD Acc	USD	1 060 389	5 626 121,77	1,96
MULTI-UNITS LUXEMBOURG - Lyxor Euro Government Bond 7-10Y (D)	EUR	172 118	27 695 507,38	9,65
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne			4 261 071,58	1,49

AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR

FCPE - Fonds d'épargne salariale

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Gestion collective			4 261 071,58	1,49
AMUNDI SENIOR IMPACT DEBT IV D1	EUR	5 000	1 010 200,00	0,35
OPCIMMO OPCIMMO P	EUR	33 195,15175	3 250 871,58	1,14
Total			277 264 090,05	96,64

(*) 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 (*)
A JPY EUR 27/09/24		-51 126,83	JPY	5 740 893,82	EUR	-5 792 020,65
Total		-51 126,83		5 740 893,82		-5 792 020,65

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

AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR

FCPE - Fonds d'épargne salariale

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				
MSCI EMG MKT 0924	29	17 588,06		1 472 255,66
MSCI WORLD 10 0924	86	95 167,72		9 030 501,52
NASDAQ 100 E- 0924	8	9 561,00		2 974 910,19
SP 500 MINI 0924	36	31 040,35		9 273 338,00
Sous-total 1.		153 357,13		22 751 005,37
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total		153 357,13		22 751 005,37

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

AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR

FCPE - Fonds d'épargne salariale

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	+/-
1. Futures				
CBOT USUL 30A 0924	40	72 603,22		4 678 096,57
EURO BOBL 0924	41	44 280,00		4 774 040,00
EURO BONO SPA 0924	58		-50 450,00	7 075 420,00
EURO BTP 0924	75		-101 250,00	8 646 750,00
EURO BUND 0924	38	51 950,00		5 001 560,00
EURO-OAT 0924	-90	92 530,00		-11 080 800,00
US 10YR NOTE 0924	68	56 012,36		6 978 248,19
XEUR FGBX BUX 0924	17	14 280,00		2 214 080,00
Sous-total 1.		331 655,58	-151 700,00	28 287 394,76
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total		331 655,58	-151 700,00	28 287 394,76

(*) 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				
E7 USDEUR 0924	802		-477 046,89	50 286 354,09
Sous-total 1.			-477 046,89	50 286 354,09
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total			-477 046,89	50 286 354,09

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

AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR

FCPE - Fonds d'épargne salariale

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.

AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR

FCPE - Fonds d'épargne salariale

Synthèse de l'inventaire

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	277 264 090,05
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	-51 126,83
Total instruments financiers à terme - actions	153 357,13
Total instruments financiers à terme - taux	179 955,58
Total instruments financiers à terme - change	-477 046,89
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 (+)	10 285 392,15
Autres passifs (-)	-459 170,12
Passifs de financement (-)	
Total = actif net	286 895 451,07

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR ASSUREUR	EUR	35 831,7607	93,72
Part AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR E	EUR	26 115,7099	92,37
Part AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR F	EUR	2 668 911,3354	94,36
Part AMUNDI HORIZON LONG TERME ESR PER	EUR	310 506,5702	94,26

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