

# Edmond de Rothschild Signatures Financial Bonds

DOCUMENT D'INFORMATION PERIODIQUE AU 30/12/2011

## **FORME JURIDIQUE DE L'OPCVM**

Fonds Commun de Placement Général

## **CLASSIFICATION**

Obligations et autres titres de créances internat.

## **AFFECTATION DES RESULTATS**

Résultat à capitaliser

## ETAT DU PATRIMOINE

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	49 510 155,40
b) Avoirs bancaires	1 781 114,28
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	5 664 643,36
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	56 955 913,04
e) Passif	-106 898,66
f) Valeur nette d'inventaire	56 849 014,38

\* Les montants sont signés

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

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur liquidative
Edmond de Rothschild Signatures Financial Bonds C	C1	35 326 125,32	441 060,332	80,09
Edmond de Rothschild Signatures Financial Bonds I	CI	21 522 889,06	21,571	997 769,64

## ELEMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Les titres financiers éligibles et des 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	65,68	65,56
b) Titres financiers éligibles et des 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	21,41	21,37
c) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
d) Les autres actifs	0,00	0,00

## MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
a) Les titres financiers éligibles et des 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	14 331 447,64	33 952 418,00
b) Titres financiers éligibles et des 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	2 650 628,81	14 107 174,16
c) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
d) Les autres actifs	0,00	0,00

## **DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE**

Aucun dividende ou acompte n'a été distribué sur la période.

## PORTEFEUILLE TITRES DETAILLE

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Obligations et valeurs assimilées</b>				
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
MUNCH RUCK TF/TV PERP *EUR	EUR	1 250 000	1 021 823,84	1,80
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>1 021 823,84</b>	<b>1,80</b>
<b>BELGIQUE</b>				
EUROCLEAR FINANCE TV PERP	EUR	1 750 000	1 342 406,11	2,36
FORTIS BQ 4 5/8%04-PERP.	EUR	2 950 000	1 751 471,82	3,08
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>3 093 877,93</b>	<b>5,44</b>
<b>ETATS UNIS AMERIQUE</b>				
BNP PARIBAS CAPITAL TRUST 6.342% 01/49	EUR	750 000	794 583,70	1,40
BNP PARIBAS CAP.5.868%03-PERP	EUR	1 900 000	1 619 466,51	2,85
CREDIT LYONNAIQ 7.047% 02-PERP.	EUR	1 750 000	1 524 622,52	2,68
MORGAN STANLEY 4.5% 23/02/2016	EUR	500 000	478 617,81	0,84
<b>TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE</b>			<b>4 417 290,54</b>	<b>7,77</b>
<b>FRANCE</b>				
AFD TF/TV 20/07/2049	EUR	1 250 000	938 979,51	1,65
AGF 4.625% 06/49	EUR	2 500 000	1 971 960,38	3,47
AXA SA TF/TV PERP.	EUR	1 500 000	1 059 213,98	1,86
AXA 5.777% 06/07/49	EUR	1 200 000	880 472,59	1,55
BANQUE POSTALE 4,375%10-301120	EUR	1 000 000	871 783,74	1,53
BFCM 4.471%05-15	EUR	3 000 000	2 079 920,33	3,67
BNP PARIBAS 8.667%08-PERPETUEL	EUR	500 000	462 816,19	0,81
BNP TF/TV 7.781% PERP	EUR	500 000	423 821,39	0,75
BPCE TF/TV PERP 07/49 SUB *EUR	EUR	250 000	148 766,46	0,26
BPCE TV 07-PERP.	EUR	2 800 000	1 631 645,84	2,87
CNP ASS 4.75%06-PERP EMTN	EUR	3 850 000	1 825 620,56	3,21
COFIDIS E3R PERP	EUR	900 000	487 411,20	0,86
CRED AGRICOLE 8.20%PERP	EUR	1 500 000	1 256 262,30	2,21
CREDIT LOGEMENT E3R 12/49	EUR	800 000	424 900,44	0,75
CREDIT LOGEMENT TV PERPETUELLE	EUR	2 700 000	1 191 666,53	2,10
GROUPAMA SA 6.298%07-PERP.TF/TV	EUR	500 000	161 366,83	0,28
LA MONDIALE 5.11% 49	EUR	1 000 000	463 230,87	0,81
MACIF TV PERP	EUR	1 500 000	768 719,26	1,35
MONDIALE 5 7/8%03-141013 TSR	EUR	1 000 000	586 912,57	1,03
SG 6.999% TV/TF PERP *EUR	EUR	1 000 000	603 059,67	1,06
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>18 238 530,64</b>	<b>32,08</b>

## PORTEFEUILLE TITRES DETAILLE (Suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>GUERNESEY</b>				
CSG GUERNESEY 7.875% 24/02/2041	USD	3 250 000	2 330 660,46	4,10
<b>TOTAL GUERNESEY</b>			<b>2 330 660,46</b>	<b>4,10</b>
<b>ITALIE</b>				
INTESA SANPAOLO 8.375% 09-PERP	EUR	2 000 000	1 427 527,32	2,51
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>1 427 527,32</b>	<b>2,51</b>
<b>JERSEY</b>				
HSBC CAPITAL FUNDING LP 5.13%04-PERP.	EUR	2 300 000	2 005 337,95	3,53
HSBC CAPITAL FUNDING 5.3687% 12/49	EUR	1 250 000	1 135 565,17	2,00
UBS CAP TF/TV PERP PF *EUR	EUR	250 000	260 193,52	0,46
UBS CAP TF/TV PF PERP *EUR	EUR	2 150 000	2 021 547,02	3,55
<b>TOTAL JERSEY</b>			<b>5 422 643,66</b>	<b>9,54</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
HANNOVER 5.75% 14/09/2040 - OBLIG TF/TV	EUR	1 250 000	1 162 994,54	2,05
UNICREDIT INTL 8.125% 10/12/49	EUR	1 800 000	1 127 114,75	1,98
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>2 290 109,29</b>	<b>4,03</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
ABN AMRO 6.375% 27/04/2021	EUR	400 000	379 237,38	0,67
GENERALI FIN. 5.479% 07-57	EUR	2 500 000	1 842 590,41	3,24
RABOBANK NEDERLAND 6.875% 19/03/2020	EUR	2 000 000	1 819 523,77	3,20
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>4 041 351,56</b>	<b>7,11</b>
<b>ROYAUME UNI</b>				
AVIVA TV08-220538 SUB EMTN	EUR	600 000	552 624,02	0,97
AVIVA 4.7291% PERP EMTN	EUR	1 250 000	909 100,98	1,60
BARCLAYS BANK 6%2018 EMTN	EUR	350 000	334 801,85	0,59
BARCLAYS BK 4.75% 03/49	EUR	3 400 000	1 759 450,77	3,10
COFINOGA FUNDING TV03-PP	EUR	417 000	294 283,28	0,52
LLOYDS TSB BANK 5.625% 03/18	EUR	2 000 000	1 616 150,00	2,84
<b>TOTAL ROYAUME UNI</b>			<b>5 466 410,90</b>	<b>9,62</b>
<b>SUEDE</b>				
SEB AB 5% PERP *EUR	EUR	1 750 000	1 759 929,26	3,10
<b>TOTAL SUEDE</b>			<b>1 759 929,26</b>	<b>3,10</b>
<b>TOTAL Obligations &amp; val. ass. ng. sur mar. régl. ou ass.</b>			<b>49 510 155,40</b>	<b>87,10</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées</b>			<b>49 510 155,40</b>	<b>87,10</b>

## PORTEFEUILLE TITRES DETAILLE (Suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Organismes de placement collectif</b>				
<b>OPCVM français à vocation générale</b>				
<b>FRANCE</b>				
Edmond de Rothschild Sécurité R	EUR	51	5 593 815,66	9,84
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>5 593 815,66</b>	<b>9,84</b>
<b>TOTAL OPCVM français à vocation générale</b>			<b>5 593 815,66</b>	<b>9,84</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>5 593 815,66</b>	<b>9,84</b>
<b>Instruments financiers à terme</b>				
<b>Engagements à terme ferme</b>				
<b>Engagements à terme ferme sur marché réglementé ou assimilé</b>				
CME CME USD/EUR 0312	USD	37	-10 082,62	-0,02
<b>TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé</b>			<b>-10 082,62</b>	<b>-0,02</b>
<b>TOTAL Engagements à terme fermes</b>			<b>-10 082,62</b>	<b>-0,02</b>
<b>TOTAL Instruments financiers à terme</b>			<b>-10 082,62</b>	<b>-0,02</b>
<b>Appel de marge</b>				
Ap marge LCFR Banque	USD	17 945	13 823,51	0,02
<b>TOTAL Appel de marge</b>			<b>13 823,51</b>	<b>0,02</b>
<b>Créances</b>			<b>57 004,19</b>	<b>0,10</b>
<b>Dettes</b>			<b>-45 163,85</b>	<b>-0,08</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>1 729 462,09</b>	<b>3,04</b>
<b>Actif net</b>			<b>56 849 014,38</b>	<b>100,00</b>
<b>Edmond de Rothschild Signatures Financial Bonds C</b>	<b>EUR</b>	<b>441 060,332</b>	<b>80,09</b>	
<b>Edmond de Rothschild Signatures Financial Bonds I</b>	<b>EUR</b>	<b>21,571</b>	<b>997 769,64</b>	