

SICAV de droit français

AMPLEGEST LONG SHORT

RAPPORT SEMESTRIEL

au 30 juin 2023

Société de gestion : AMPLEGEST
Dépositaire : Caceis Bank
Commissaire aux comptes : Pricewaterhousecoopers Audit

AMPLEGEST - 50 Boulevard Haussmann - 75009 - Paris

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	31 388 727,97
b) Avoirs bancaires	1 304 321,88
c) Autres actifs détenus par l'OPC	6 594 375,12
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	39 287 424,97
e) Passif	-675 491,06
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	38 611 933,91

* Les montants sont signés

NOMBRE D'ACTIONS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

Action	Type d'action	Actif net par action	Nombre d'actions en circulation	Valeur nette d'inventaire par action
AMPLEGEST LONG SHORT AC en EUR	C	26 660 937,11	243 542,1819	109,47
AMPLEGEST LONG SHORT IC en EUR	C	11 231 572,63	98 375,6367	114,17
AMPLEGEST LONG SHORT SC en EUR	C	719 424,17	6 153,0000	116,92

ELEMENT DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
<p>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-I du code monétaire et financier.</p> <p>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.</p>	79,18	77,82
<p>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.</p>	2,11	2,07
<p>D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.</p>		
<p>E) Les autres actifs.</p>	9,85	9,68

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

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

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Euro	EUR	31 388 727,97	81,29	79,90
TOTAL		31 388 727,97	81,29	79,90

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

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

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RESIDENCE DE L'EMETTEUR

Pays	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
FRANCE	48,74	47,90
ALLEMAGNE	6,05	5,95
ESPAGNE	5,82	5,72
PAYS-BAS	5,55	5,45
ITALIE	4,63	4,55
IRLANDE	3,90	3,83
SUISSE	2,11	2,07
PORTUGAL	1,65	1,62
AUTRICHE	1,62	1,60
BELGIQUE	1,22	1,20
TOTAL	81,29	79,90

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

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

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

Nature d'actifs	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Organismes de placement collectif		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	9,85	9,68
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE		
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés		
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés		
Autres organismes non européens		
Autres actifs		
Autres		
TOTAL	9,85	9,68

* 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 PERIODE 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-I 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.	9 394 571,21	16 133 489,22
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.	333 819,34	567 794,61
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-I I du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	796 199,25	

INFORMATIONS DIVERSES

Etablissement dépositaire : *Caceis Bank - 12 place des États-Unis - CS 40083 - 92549 - Montrouge Cedex*

Le relevé Périodicité Semestrielle détaillé de l'actif est disponible dans un délai de huit semaines à compter de la fin de la période. Il peut être transmis sur simple demande auprès de la société de gestion :

AMPLEGEST - *50 Boulevard Haussmann - 75009 - Paris*

INFORMATION SUR LES FRAIS DE GESTION VARIABLES

	30/06/2023
Action AMLEGEST LONG SHORT AC Frais de gestion variables provisionnés Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés Frais de gestion variables acquis Pourcentage de frais de gestion variables acquis	1,09
Action AMLEGEST LONG SHORT IC Frais de gestion variables provisionnés Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés Frais de gestion variables acquis Pourcentage de frais de gestion variables acquis	
Action AMLEGEST LONG SHORT SC Frais de gestion variables provisionnés Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés Frais de gestion variables acquis Pourcentage de frais de gestion variables acquis	

« Le montant des frais de gestion variables affiché ci-dessus correspond à la somme des provisions et reprises de provisions ayant impacté l'actif net au cours de la période sous revue.»

**TRANSPARENCE DES OPERATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA REUTILISATION
DES INSTRUMENTS FINANCIERS - REGLEMENT 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 réglementation SFTR.

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Actions et valeurs assimilées				
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
HEIDELBERGER ZEMENT	EUR	1 900	142 880,00	0,37
INFINEON TECHNOLOGIES	EUR	10 700	404 299,50	1,05
LANXESS AG	EUR	6 500	179 400,00	0,47
PORSCHE A HOLDING	EUR	5 000	275 800,00	0,71
SIEMENS AG-REG	EUR	5 930	904 562,20	2,35
TRATON SE	EUR	21 950	430 220,00	1,11
TOTAL ALLEMAGNE			2 337 161,70	6,06
AUTRICHE				
WIENERBERGER AG	EUR	22 350	626 694,00	1,62
TOTAL AUTRICHE			626 694,00	1,62
BELGIQUE				
UNION CHIMIQUE BELGE/ UCB	EUR	3 000	243 600,00	0,63
X-FAB SILICON FOUNDRIES SE	EUR	23 000	228 160,00	0,59
TOTAL BELGIQUE			471 760,00	1,22
ESPAGNE				
ACERINOX	EUR	45 100	438 552,40	1,14
BANCO DE BILBAO VIZCAYA S.A.	EUR	65 000	457 080,00	1,18
BANCO SANTANDER S.A.	EUR	222 241	752 285,79	1,95
IBERDROLA SA	EUR	50 000	597 500,00	1,55
TOTAL ESPAGNE			2 245 418,19	5,82
FRANCE				
AIR LIQUIDE	EUR	3 666	601 957,20	1,55
ALD SA	EUR	41 859	410 427,50	1,07
ALTEN	EUR	1 200	173 160,00	0,45
AMUNDI	EUR	13 500	729 675,00	1,89
ANTIN INFRASTRUCTURE PARTNER	EUR	47 204	702 395,52	1,82
ARKEMA	EUR	4 000	345 200,00	0,89
BNP PARIBAS	EUR	11 085	639 826,20	1,65
BOLLORE SE	EUR	20 000	114 200,00	0,30
BOUYGUES	EUR	30 976	952 821,76	2,47
CHRISTIAN DIOR	EUR	350	284 550,00	0,74
COMPAGNIE DE L'ODET	EUR	300	466 200,00	1,21
CREDIT AGRICOLE	EUR	36 960	401 829,12	1,04
ELIS	EUR	31 158	554 612,40	1,44

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
FAURECIA EX BERTRAND FAURE	EUR	5 290	114 105,30	0,29
FNAC DARTY RTS 29-06-23	EUR	9 384		
GROUPE FNAC	EUR	9 384	321 871,20	0,84
HOFFMANN GREEN CEMENT TECHNO	EUR	11 568	119 844,48	0,31
KERING	EUR	400	202 240,00	0,53
L'OREAL	EUR	850	363 035,00	0,94
LVMH (LOUIS VUITTON - MOET HENNESSY)	EUR	250	215 750,00	0,56
M6 METROPOLE TELEVISION	EUR	30 500	395 890,00	1,02
MERSEN	EUR	6 863	284 814,50	0,73
NEXANS SA	EUR	5 300	420 555,00	1,08
PLASTIC OMNIUM	EUR	14 426	232 114,34	0,61
RUBIS	EUR	22 691	504 647,84	1,31
SAFRAN SA	EUR	8 838	1 267 899,48	3,29
SAINT-GOBAIN	EUR	4 000	222 920,00	0,58
SANOFI	EUR	8 300	815 060,00	2,11
SCHNEIDER ELECTRIC SE	EUR	2 900	482 734,00	1,25
SCOR SE	EUR	32 857	883 524,73	2,29
SOCIETE GENERALE SA	EUR	33 300	792 540,00	2,05
SOITEC SA	EUR	5 810	900 259,50	2,33
SR TELEPERFORMANCE	EUR	3 033	465 413,85	1,20
TIKEHAU CAPITAL	EUR	17 330	392 524,50	1,02
UBI SOFT ENTERTAINMENT	EUR	31 000	802 280,00	2,07
VEOLIA ENVIRONNEMENT	EUR	15 000	434 250,00	1,12
VIVENDI	EUR	87 659	736 861,55	1,91
WORLDLINE SA	EUR	31 989	1 071 631,50	2,78
TOTAL FRANCE			18 819 621,47	48,74
IRLANDE				
KERRY GROUP PLC-A	EUR	4 500	402 210,00	1,04
KINGSPAN GROUP	EUR	5 200	316 680,00	0,82
RYANAIR HOLDINGS PLC	EUR	45 750	787 586,25	2,04
TOTAL IRLANDE			1 506 476,25	3,90
ITALIE				
ENEL SPA	EUR	158 000	974 544,00	2,53
NEXI SPA	EUR	68 993	495 507,73	1,28
PIRELLI & C. SPA	EUR	70 387	318 430,79	0,82
TOTAL ITALIE			1 788 482,52	4,63
PAYS-BAS				
AALBERTS INDUSTRIES	EUR	10 200	393 006,00	1,02

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
AALBERTS INDUSTRIES NV RTS	EUR	10 200		
AIRBUS SE	EUR	7 750	1 025 790,00	2,66
ARISTON HOLDING NV	EUR	49 880	482 838,40	1,25
STELLANTIS NV	EUR	15 000	241 200,00	0,62
TOTAL PAYS-BAS			2 142 834,40	5,55
PORTUGAL				
ELEC DE PORTUGAL	EUR	142 149	636 258,92	1,64
TOTAL PORTUGAL			636 258,92	1,64
SUISSE				
STMICROELECTRONICS NV	EUR	17 867	814 020,52	2,11
TOTAL SUISSE			814 020,52	2,11
TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			31 388 727,97	81,29
TOTAL Actions et valeurs assimilées			31 388 727,97	81,29
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
LUXEMBOURG				
OCTO CREDIT COURT TERME-A	EUR	355	3 804 393,00	9,86
TOTAL LUXEMBOURG			3 804 393,00	9,86
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			3 804 393,00	9,86
TOTAL Organismes de placement collectif			3 804 393,00	9,86
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
DJES BANKS 0923	EUR	-125	-25 187,50	-0,07
DJ STX600 AUT 0923	EUR	-47	2 375,00	0,01
EURO STOXX 50 0923	EUR	-305	-78 975,00	-0,20
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			-101 787,50	-0,26
TOTAL Engagements à terme fermes			-101 787,50	-0,26
Autres instruments financiers à terme				
CFD				
CFD ADYEN MS 1230	EUR	-100	-4 480,00	-0,01
CFD CDI DIOR MS 1230	EUR	150	4 350,00	0,01
CFD DBK DEUTSC 1230	EUR	965	424,60	0,01
CFD I09 MS ENEL 1230	EUR	30 000	2 640,00	0,01
CFD IAG AIRLIN 1230	GBP	335 544	18 961,04	0,05

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD MS AAK AB 1230	SEK	-7 300	-123,67	
CFD MS AIXTRON 1230	EUR	-9 746	-21 733,58	-0,07
CFD MS ASHTEAD 1230	GBP	-4 250	-5 490,46	-0,01
CFD MS BARCLAYS 1230	GBP	198 000	19 516,71	0,05
CFD MS BAYERISC 1230	EUR	-2 000	-9 560,20	-0,03
CFD MS BUNZL PL 1230	GBP	-16 591	-7 345,60	-0,02
CFD MS COMMERZB 1230	EUR	-44 569	-24 869,50	-0,07
CFD MS D'IETERE 1230	EUR	-890	-4 450,00	-0,02
CFD MS DAVIDE E 1230	EUR	-12 000	-6 180,00	-0,02
CFD MS DEUTSCHE 1230	EUR	-46 300	-9 352,60	-0,03
CFD MS DOMETIC 1230	SEK	12 500	1 545,89	
CFD MS DR. MART 1230	GBP	240 800	6 452,91	0,02
CFD MS DUFREY AG 1230	CHF	10 000	24 111,16	0,06
CFD MS EASY GBP 1230	GBP	40 000	4 147,83	0,01
CFD MS EMS-CHEM 1230	CHF	-662	-7 777,89	-0,02
CFD MS EXPERIAN 1230	GBP	-4 600	-5 895,51	-0,02
CFD MSF SIE EUR 1230	EUR	-700	2 058,00	0,01
CFD MS GERRESHE 1230	EUR	-4 700	10 340,00	0,02
CFD MS ING GROE 1230	EUR	-8 951	-4 421,79	-0,01
CFD MS KELLER G 1230	GBP	50 000	8 738,41	0,02
CFD MS LAFARGEH 1230	CHF	-4 150	-3 222,31	-0,01
CFD MS LEROY SE 1230	NOK	62 000	-2 330,83	-0,01
CFD MS L OREAL 1230	EUR	-400	-9 260,00	-0,02
CFD MS MONCLER 1230	EUR	-5 553	-5 886,18	-0,01
CFD MS NEMETSCH 1230	EUR	-1 800	-828,00	
CFD MS NEXI SPA 1230	EUR	40 000	8 480,00	0,02
CFD MS ORANGE 1230	EUR	-17 136	-5 517,79	-0,01
CFD MS RATIONAL 1230	EUR	-496	-17 608,00	-0,05
CFD MS REXEL SA 1230	EUR	-3 650	-2 774,00	-0,01
CFD MS S.O.I.T. 1230	EUR	723	8 025,30	0,03
CFD MS SEGRO PL 1230	GBP	-25 000	-2 330,24	
CFD MS STMICROE 1230	EUR	-3 000	-6 105,00	-0,02
CFD MS THE SAGE 1230	GBP	-35 000	-23 162,60	-0,06
CFD MS UBISOFT 1230	EUR	490	68,60	
CFD MS VINCI 1230	EUR	-2 100	-4 872,00	-0,01
CFD MS VOLVO AB 1230	SEK	-9 750	-7 515,56	-0,02
CFD MS WIENERBE 1230	EUR	4 550	5 005,00	0,02
CFD MS WOLTERS 1230	EUR	-2 600	-1 430,00	

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CFD RMS HERMES 1230	EUR	-150	-11 190,00	-0,03
MS INTERCONTINENTAL	GBP	-2 302	-5 417,86	-0,01
MS NIBE SEK 1230	SEK	-32 340	-11 505,48	-0,03
S46 MS START 1230	EUR	-425	-3 995,00	-0,01
TOTAL CFD			-111 766,20	-0,30
TOTAL Autres instruments financiers à terme			-111 766,20	-0,30
TOTAL Instrument financier à terme			-213 553,70	-0,56
Appel de marge				
APPEL MARGE CACEIS	EUR	101 787,5	101 787,50	0,27
TOTAL Appel de marge			101 787,50	0,27
Créances			2 560 954,17	6,63
Dettes			-190 798,87	-0,50
Comptes financiers			1 160 423,84	3,01
Actif net			38 611 933,91	100,00