FCP de droit français

STRATEGIE INDICE JAPON

RAPPORT SEMESTRIEL

au 30 juin 2023

Société de gestion : Apicil Asset Management
Dépositaire : Caceis Bank
Commissaire aux comptes : Deloitte & Associés

Apicil Asset Management - 20 rue de la Baume - 75008 - 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	14 970 788,12
b) Avoirs bancaires	619 278,26
c) Autres actifs détenus par l'OPC	19 220 501,02
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	34 810 567,40
e) Passif	-17 328 229,95
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	17 482 337,45

*** 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 nette d'inventaire par part
STRATEGIE INDICE JAPON	C	17 482 337,45	2 069,565	8 447,35

ELEMENT 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.	85,63	43,01
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.		
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	7,00	3,51

* *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	14 970 788,12	85,63	43,01
TOTAL		14 970 788,12	85,63	43,01

* *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	85,63	43,01
TOTAL	85,63	43,01

* *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	7,00	3,51
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	7,00	3,51

* *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. 422-1 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.	54 118 729,24	53 300 000,00
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.		
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.		

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 :

Apicil Asset Management - *20 rue de la Baume - 75008 - Paris*

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 règlementation SFTR.

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2023 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
FRANCE				
0473820FRENCH R ZCP 020823	EUR	2 500 000	2 493 057,92	14,26
FRANCE TREASURY BILL ZCP 050723	EUR	2 900 000	2 899 083,09	16,58
FRANCE TREASURY BILL ZCP 160823	EUR	1 200 000	1 194 972,81	6,83
FRAN TREA BILL BTF ZCP 19-07-23	EUR	2 600 000	2 596 144,85	14,85
FREN REP PRES ZCP 09-08-23	EUR	2 800 000	2 790 223,30	15,97
FREN REP PRES ZCP 12-07-23	EUR	3 000 000	2 997 306,15	17,14
TOTAL FRANCE			**14 970 788,12**	**85,63**
TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			**14 970 788,12**	**85,63**
TOTAL Titres de créances			**14 970 788,12**	**85,63**
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI IC	EUR	5,22	1 222 981,28	7,00
TOTAL FRANCE			**1 222 981,28**	**7,00**
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			**1 222 981,28**	**7,00**
TOTAL Organismes de placement collectif			**1 222 981,28**	**7,00**
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
M-TOPIX (TOK) 0923	JPY	43	5 814,14	0,03
OSE TOPIX FUT 0923	JPY	116	298 931,03	1,71
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			**304 745,17**	**1,74**
TOTAL Engagements à terme fermes			**304 745,17**	**1,74**
TOTAL Instrument financier à terme			**304 745,17**	**1,74**
Appel de marge				
APPEL MARGE CACEIS	JPY	-47 893 749	-304 745,16	-1,74
TOTAL Appel de marge			**-304 745,16**	**-1,74**
Créances			**17 692 774,57**	**101,20**
Dettes			**-17 023 484,79**	**-97,37**
Comptes financiers			**619 278,26**	**3,54**
Actif net			**17 482 337,45**	**100,00**

STRATEGIE INDICE JAPON

Fonds Commun de Placement

Société de Gestion :
APICIL Asset Management

20, rue de la Baume
75008 Paris

Attestation du Commissaire aux Comptes relative à la composition de l'actif

au 30 juin 2023

Deloitte & Associés
6 place de la Pyramide
92908 Paris-La Défense Cedex
France
Téléphone : + 33 (0) 1 40 88 28 00
www.deloitte.fr

Adresse postale :
TSA 20303
92030 La Défense Cedex

STRATEGIE INDICE JAPON

Fonds Commun de Placement

Société de Gestion :
APICIL Asset Management

20, rue de la Baume
75008 Paris

Attestation du Commissaire aux Comptes relative à la composition de l'actif

au 30 juin 2023

En notre qualité de commissaire aux comptes du Fonds Commun de Placement STRATEGIE INDICE JAPON et en application des dispositions prévues par l'article L 214-17 du Code monétaire et financier relatives au contrôle de la composition de l'actif, nous avons établi la présente attestation sur les informations figurant dans la composition de l'actif au 30 juin 2023 ci-jointe.

Ces informations ont été établies sous la responsabilité de la société de gestion. Il nous appartient de nous prononcer sur la cohérence des informations contenues dans la composition de l'actif avec la connaissance que nous avons de l'OPC acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Nous avons mis en œuvre les diligences que nous avons estimé nécessaires au regard de la doctrine professionnelle de la Compagnie nationale des commissaires aux comptes relative à cette mission. Ces diligences, qui ne constituent ni un audit ni un examen limité, ont consisté essentiellement à réaliser des procédures analytiques et des entretiens avec les personnes qui produisent et contrôlent les informations données.

Sur la base de nos travaux, nous n'avons pas d'observation à formuler sur la cohérence des informations figurant dans le document joint avec la connaissance que nous avons de l'OPC acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

A Paris La Défense, le 24 août 2023

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés

Virginie GAITTE

Société par actions simplifiée au capital de 2 188 160 €
Société d'Expertise Comptable inscrite au Tableau de l'Ordre de Paris Ile-de-France
Société de Commissariat aux Comptes inscrite à la Compagnie Régionale de Versailles
572 028 041 RCS Nanterre
TVA : FR 02 572 028 041

Une entité du réseau Deloitte

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23 Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore
PORTEFEUILLE : 659012 STRATEGIE INDICE JAPON VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , 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	I F	<---------- PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	----------> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
II -Titres de creances													
TCN negocies sur marche regl.ou ass													
Bons du tresor													
DEVISE VALEUR : EUR EURO													
MATURITE : Inférieure à 3 mois													
FR0127317016 FREN REP P ZCP 07-23	NOL	(999) 120723	3,000,000.	EUR	99.551	17/05/23	2.946	L	2,986,530.75	2,997,306.15	0.00	10,775.40	17.14
FR0127317024 FREN REP P ZCP 08-23	NOL	(999) 090823	2,800,000.	EUR	99.5703	21/06/23	3.269	L	2,787,967.14	2,790,223.30	0.00	2,256.16	15.96
FR0127921098 FRANCE 050723	NOL	(999) 050723	2,900,000.	EUR	99.5653	10/05/23	2.882	L	2,887,392.52	2,899,083.09	0.00	11,690.57	16.58
FR0127921106 FRAN TREA ZCP 07-23	NOL	(999) 190723	2,600,000.	EUR	99.5469	24/05/23	3.027	L	2,588,220.36	2,596,144.85	0.00	7,924.49	14.85
FR0127921114 FRENCH 020823	NOL	(999) 020823	2,500,000.	EUR	99.5835	14/06/23	3.153	L	2,489,586.88	2,493,057.92	0.00	3,471.04	14.26
FR0127921122 FRANCE 160823	NOL	(999) 160823	1,200,000.	EUR	99.5629	28/06/23	3.308	L	1,194,754.24	1,194,972.81	0.00	218.57	6.84
SOUS TOTAL MATURITE : Inférieure à 3 mois													
						CUMUL (EUR)			14,934,451.89	14,970,788.12	0.00	36,336.23	85.63
III - Titres d'OPCVM													
OPCVM français à vocation générale													
DEVISE VALEUR : EUR EURO													
FR0010251660 AM EUR LIQU IC			5.22	P EUR	230809.2759	M 02/07/23	234287.6021	5	1,204,824.42	1,222,981.28	0.00	18,156.86	7.00
VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHES A TERME													
Engagements à terme fermes													
Futures étrangers													
SOUS-JACENT : TPX TOPIX INDEX (TOKYO)													
ITMI___U3 M-TOPIX (TOK) 0923			43.	JPY	2266.75	M 30/06/23	2288.	4	0.00	5,814.14	0.00	5,814.14	0.03
ITP___U3 OSE TOPIX FUT 0923			116.	JPY	2247.5	M 30/06/23	2288.	4	0.00	298,931.03	0.00	298,931.03	1.71
SOUS TOTAL SOUS-JACENT : TPX TOPIX INDEX (TOKYO)													
						CUMUL (EUR)			0.00	304,745.17	0.00	304,745.17	1.74
VIII - TRESORERIE													
Dettes et créances													
Deposit													
DEVISE VALEUR : JPY YEN													
DGMCIJPY Dépôt gar. CACEIS BK			140,751,000.	JPY	0.0071754	30/06/23	0.00636294		1,009,944.83	895,590.48	0.00	-114,354.35	5.12
Appels de marge													
DEVISE VALEUR : JPY YEN													
MARCIJPY Appel Marge CACEIS			-47,893,749.	JPY	0.00636085	30/06/23	0.00636294		-304,644.75	-304,745.16	0.00	-100.41	-1.74

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23 Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore
PORTEFEUILLE : 659012 STRATEGIE INDICE JAPON VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , 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	I F	<---------- PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	----------> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
	Frais de gestion													
	DEVISE VALEUR : EUR EURO													
FGPVFEUR	Frais de Gest. Fixe			-50,701.83	EUR	1.	30/06/23	1.		-50,701.83	-50,701.83	0.00	0.00	-0.29
Dettes et créances														
							CUMUL (EUR)			654,598.25	540,143.49	0.00	-114,454.76	3.09
Disponibilités														
	Avoirs en france													
	DEVISE VALEUR : EUR EURO													
BQCIEUR	CACEIS Bank			139,788.56	EUR	1.	30/06/23	1.		139,788.56	139,788.56	0.00	0.00	0.80
	DEVISE VALEUR : JPY YEN													
BQCIJPY	CACEIS Bank			75,356,602.	JPY	0.00642878	30/06/23	0.00636294		484,451.13	479,489.70	0.00	-4,961.43	2.74
	Avoirs en france													
							CUMUL (EUR)			624,239.69	619,278.26	0.00	-4,961.43	3.54
	Opérations à terme													
	DATE ECHEANCE : 07/09/23													
ICAT0001Q0MI	V/EUR/JPY/20230907	RECU	07/09/23	2,330,000,000.	JPY	1.	30/06/23	1.		15,746,254.18	14,825,655.38	0.00	-920,598.80	84.80
		VERSE	07/09/23	-15,746,254.18	EUR	147.9717	30/06/23	156.0950196		-15,746,254.18	-15,639,551.13	0.00	106,703.05	-89.46
ICAT0001Q7F4	A/JPY/EUR/20230907	RECU	07/09/23	200,000,000.	JPY	0.0067	30/06/23	0.00640636		1,333,231.83	1,281,272.10	0.00	-51,959.73	7.33
		VERSE	07/09/23	-1,333,231.83	EUR	1.	30/06/23	1.		-1,333,231.83	-1,333,231.83	0.00	0.00	-7.63
	SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 07/09/23													
							CUMUL (EUR)			0.00	-865,855.48	0.00	-865,855.48	-4.95
	Collatéral Cash													
	DEVISE VALEUR : EUR EURO													
C0020433	COLLATERAL			690,256.61	EUR	1.	30/06/23	1.		690,256.61	690,256.61	0.00	0.00	3.95
Disponibilités														
							CUMUL (EUR)			1,314,496.30	443,679.39	0.00	-870,816.91	2.54
VIII - TRESORERIE														
							CUMUL (EUR)			1,969,094.55	983,822.88	0.00	-985,271.67	5.63
PORTEFEUILLE : STRATEGIE INDICE JAPON (659012)														
							(EUR)			18,108,370.86	17,482,337.45	0.00	-626,033.41	100.00

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23 Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore
PORTEFEUILLE : 659012 STRATEGIE INDICE JAPON VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

Portefeuille titres : 15,632,659.09

Frais de gestion du jour
Frais de Gest. Fixe : 574.78 EUR

Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
C0 FR0000435174 STRATEGIE INDICE JAP	EUR	17,482,337.45	2,069.56458	8,447.35	100.			8,447.35	8,447.35

Actif net total en EUR : 17,482,337.45

Precedente VL en date du 29/06/23 :

C0 STRATEGIE INDICE JAP Prec. VL : 8,427.81 (EUR) Variation : +0.232%

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23 Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore
PORTEFEUILLE : 659012 STRATEGIE INDICE JAPON VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

COURS DES DEVISES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente		variation
Cours EUR en JPY :	157.16	cotation : 30/06/23	0.		157.74	cotation : 29/06/23	-0.36769
Cours JPY en EUR :	0.0063629422	cotation : 30/06/23	0.		0.0063395461	cotation : 29/06/23	0.36905

COURS INVERSES DES DEVISES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente	
Cours JPY en EUR :	0.0063629422	cotation : 30/06/23	0.		0.006339546	cotation : 29/06/23
Cours EUR en JPY :	157.1600006047	cotation : 30/06/23	0.		157.7399997138	cotation : 29/06/23