

ANNEXE 12
INVENTAIRE DES ACTIFS

OPCVM :
Gestionnaire
Dépositaire

FCP ALISTITMAR CHAABI TRESORERIE
ETABLISSEMENT GESTIONNAIRE ALISTITMAR CHAABI
BANQUE CENTRALE POPULAIRE

Semestre clos le : 30/06/2004

Emetteur	Nature de titre	Code Titre	Désignation	Quantité	Prix de Revient Global en DH	Valorisation par titre en DH	Valeur globale en DH	+ / - valeur en DH	% par rapport au total
AF GAZ	Obligations	009009	AF GAZ 11/07/02 3A 6.20%	4	400 000,00	107 884,57	431 538,28	31 538,28	0,05%
BMCI	TCN	150157	CD BMCI 050899 6,5	40	10 506 585,20	265 285,55	10 611 422,00	104 836,80	1,22%
BMCILEAS	TCN	002066	BMCILEAS 090399 8	465	930 000,00	2 154,96	1 002 056,40	72 056,40	0,12%
C H AUTO	TCN	140059	BT C H AUTO 240504 3.60%	100	10 000 000,00	100 376,62	10 037 662,00	37 662,00	1,16%
CAC	TCN	140061	BT CAC 140604 3.60%	100	10 000 000,00	100 160,53	10 016 053,00	16 053,00	1,15%
CHARAF	TCN	140060	BT CHARAF 10/06/04 3.50%	35	3 500 000,00	100 234,30	3 508 200,50	8 200,50	0,40%
		140063	BT CHARAF 17/06/04 3.50%	10	1 000 000,00	100 131,08	1 001 310,80	1 310,80	0,12%
CREDOR	TCN	100134	BSFCRED1711996,4	24	6 219 695,76	262 172,77	6 292 146,48	72 450,72	0,72%
EQDOM	TCN	100380	BSF EQDOM 3A 280604	50	5 000 000,00	100 719,24	5 035 962,00	35 962,00	0,58%
ETAT	TCN	200563	BDT 150402 6% 5A	140	15 081 157,00	107 903,57	15 106 499,80	25 342,80	1,74%
		200569	BDT 010702 5.60% 5A	45	5 005 691,55	111 412,90	5 013 580,50	7 888,95	0,58%
		200671	BDT 040803 3,45	250	25 762 172,50	103 786,45	25 946 612,50	184 440,00	2,99%
		200700	BT 21/03/04 52S 3.40%	300	30 063 015,00	101 696,26	30 508 878,00	445 863,00	3,51%
		200704	BT 08/03/04 26S 3.03%	500	50 000 000,00	101 058,62	50 529 310,00	529 310,00	5,82%
		200712	BT 26/04/04 52S 3%	98	9 859 780,00	100 810,59	9 879 437,82	19 657,82	1,14%
FEC	Obligations	009018	FEC 17/03/03 5A 5.55%	100	10 000 000,00	101 350,42	10 135 042,00	135 042,00	1,17%
MAG STEEL	TCN	140064	BT MAG STEEL 170604 3.25	50	5 000 000,00	100 122,34	5 006 117,00	6 117,00	0,58%
MAGHBL	TCN	100142	BSF MAGHBL 091299	40	10 334 052,40	261 277,28	10 451 091,20	117 038,80	1,20%
ODEP	Obligations	009043	ODEP 02/03/04 5.20%	31	3 100 000,00	103 084,35	3 195 614,85	95 614,85	0,37%
ONA	TCN	140057	BT ONA 170504 3.30%	250	25 000 000,00	100 667,85	25 166 962,50	166 962,50	2,90%
	Obligations	009008	ONA 28/06/02 5A 6.35%	234	23 655 048,18	105 794,76	24 755 973,84	1 100 925,66	2,85%
ONE	TCN	140050	BT ONE 05/04/04 3.45%	30	3 000 000,00	101 201,22	3 036 036,60	36 036,60	0,35%
PROMOPHA	TCN	140055	BT PROMOPHA 04/0504 3.45%	50	5 000 000,00	100 546,40	5 027 320,00	27 320,00	0,58%
SOFAC	TCN	100291	BSF SOF05/02/03 3A 6%	50	5 000 000,00	104 545,09	5 227 254,50	227 254,50	0,60%
Dépôt à terme (2ans et plus)									
Liquidités							56 658 874,12		6,52%
Total							333 580 956,69		31,87%


Liste des bons du trésor reçus en Repo

Emetteur	Nature de titre	Code Titre	Désignation	Quantité	Prix de Revient Global en DH	Valorisation par titre en DH	Valeur globale en DH	+ / - value en DH	% par rapport au total
ETAT	TCN	200694	BT 030204 5A 4,70%	400	41 614 600,00	41 614 600,00	41 684 826,19	70 226,19	4,80%
		200693	BT 190104 5A 4,70%	240	25 112 203,20	25 112 203,20	25 125 596,56	13 393,36	2,89%
		200028	BT 230295 15A 10,5%	124	41 804 917,32	41 804 917,32	41 804 917,32	0,00	4,81%
		200713	BT 200704 5A 4,30%	157	15 847 149,82	15 847 149,82	15 847 149,82	0,00	1,82%
		200549	BT 140102 5A 6,20%	182	19 826 333,80	19 826 333,80	19 826 333,80	0,00	2,28%
		200624	BT 030203 5A 4,95%	253	26 856 286,49	26 856 286,49	26 856 286,49	0,00	3,09%
		200708	BT 050404 15A 5,80%	3135	321 702 978,30	321 702 978,30	321 702 978,30	0,00	37,03%
		200688	BT 151203 5A 4,90%	54	5 747 908,50	5 747 908,50	5 747 908,50	0,00	0,66%
		200708	BT 050404 15A 5,80%	62	6 595 105,54	6 595 105,54	6 595 105,54	0,00	0,76%
		200231	BT 101197 10A 9%	98	30 016 238,70	30 016 238,70	30 016 238,70	0,00	3,45%
Total							535 207 341,22		61,60%
TOTAL ACTIF NET							868 788 297,91		93,48%

Certifié sincère par la Banque Centrale Populaire : Département Valeurs Mobilières

R. MOUSSADI
 Chargé D'études

M. BOUFOUS
 Chef de Service


 101, Bd. Zerktouni
 CASABLANCA