



INVENTAIRE DES ACTIFS (EN DH)

STC / SUPPORTS

CCD, Titres et Contrôle Dépositaire d'OPCVM

OPCVM : Wafa ASSURANCE SECURITE

Semestre clos le 30/06/2006

Gestionnaire *GESTFONDS*

Dépositaire : *ATTIJARIWafa BANK*

Emetteur	Nature titre	Code valeur	Libellée valeur	Quantité	Prix revient	Cours	Valorisation	+ ou - Values	% / total
FONDS D'EQUIPEMENT COMMUNAL	OBLIGATIONS PRIVEES	2004	OBL.12.75%.150000."16/10/2007	28	561 931,72	21 795,48	610 273,44	-2 034,95	0,02%
FONDS D'EQUIPEMENT COMMUNAL	OBLIGATIONS PRIVEES	2005	OBL.12.75%.150000."19/11/2007	14	262 496,75	21 557,95	301 811,30	17 398,72	0,01%
CIH	OBLIGATIONS PRIVEES	2022	OBL.12.75%.150000."22/03/2008	40	804 696,54	20 698,63	827 945,20	-18 401,34	0,03%
CIH	OBLIGATIONS PRIVEES	2023	OBL.12.75%.150000."26/04/2008	7	140 692,79	20 454,11	143 178,77	-687,35	0,00%
CIH	OBLIGATIONS PRIVEES	2024	OBL.12.75%.150000."28/05/2008	10	201 144,93	20 230,55	202 305,50	-1 106,10	0,01%
CIH	OBLIGATIONS PRIVEES	2027	OBL.12.75%.200000."30/09/2008	30	1 202 815,57	43 814,57	1 314 437,10	-3 130,36	0,04%
CIH	OBLIGATIONS PRIVEES	2028	OBL.12.75%.150000."29/10/2008	14	421 161,44	32 556,99	455 797,86	-1 212,33	0,01%
CIH	OBLIGATIONS PRIVEES	2029	OBL.12.75%.200000."18/11/2008	25	1 001 941,56	43 129,91	1 078 247,75	-2 318,81	0,03%
CIH	OBLIGATIONS PRIVEES	2030	OBL.12.75%.200000."24/12/2008	30	1 203 028,57	42 626,89	1 278 806,70	-29 629,12	0,04%
CIH	OBLIGATIONS PRIVEES	2031	OBL.11%.200000."12/05/2009	13	174 778,59	45 531,21	591 905,73	409 500,66	0,02%
CIH	OBLIGATIONS PRIVEES	2033	OBL.11%.150000."25/08/2009	60	2 404 945,14	43 724,93	2 623 495,80	-5 116,01	0,08%
CIH	OBLIGATIONS PRIVEES	2035	OBL.11%.150000."01/12/2009	30	1 201 809,47	42 543,56	1 276 306,80	-2 136,00	0,04%
CIH	OBLIGATIONS PRIVEES	2039	OBL.10.5%.150000."28/07/2010	61	3 056 312,69	54 847,26	3 345 682,86	-5 971,50	0,11%
CIH	OBLIGATIONS PRIVEES	2040	OBL.10.5%.100000."30/08/2010	50	1 669 557,34	36 248,37	1 812 418,50	-2 972,16	0,06%
CIH	OBLIGATIONS PRIVEES	2041	OBL.10.5%.150000."29/09/2010	200	10 013 424,02	53 941,10	10 788 220,00	-15 620,68	0,35%
CIH	OBLIGATIONS PRIVEES	2067	OBL.8.5%.15000."22/03/2014	1481	11 850 163,71	9 473,91	14 030 860,71	1 906 547,45	0,45%
ONCF	OBLIGATIONS PRIVEES	9004	OBL.6.95%.150000."28/05/2017	515	56 650 000,00	126 094,02	64 938 420,30	7 932 456,57	2,09%
TRESOR	OBLIGATIONS	200054	BDT .10.5%.1000000."19/02/2011	34	16 985 125,00	662 740,97	22 533 192,98	4 898 526,32	0,73%
TRESOR	OBLIGATIONS	200063	BDT .10.5%.500000."08/04/2011	58	38 347 144,69	659 272,39	38 237 798,62	-802 929,38	1,23%
TRESOR	OBLIGATIONS	200068	BDT .10.5%.500000."22/04/2011	16	7 997 315,04	658 257,46	10 532 119,36	2 376 137,66	0,34%
TRESOR	OBLIGATIONS	200075	BDT .10.5%.500000."10/06/2011	46	22 990 075,50	654 709,47	30 116 635,62	6 992 393,46	0,97%
TRESOR	OBLIGATIONS	200085	BDT .10.5%.500000."22/07/2011	42	20 994 462,30	704 051,10	29 570 146,20	6 505 433,91	0,95%
TRESOR	OBLIGATIONS	200088	BDT .10.5%.500000."12/08/2011	40	19 990 570,68	702 417,12	28 096 684,80	6 251 114,12	0,90%
TRESOR	OBLIGATIONS	200094	BDT .10.5%.250000."02/09/2011	70	17 488 113,77	350 391,06	24 527 374,20	5 518 218,77	0,79%
TRESOR	OBLIGATIONS	200109	BDT .10.5%.250000."14/10/2011	60	14 992 328,80	348 756,01	20 925 360,60	4 813 031,81	0,67%

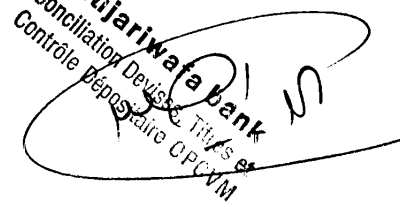
Emetteur	Nature titre	Code valeur	Libellée valeur	Quantité	Prix revient	Cours	Valorisation	+ ou - Values	% / total
TRESOR	OBLIGATIONS	200120	BDT .10.5%.250000."11/11/2011	60	14 989 631,80	347 663,53	20 859 811,80	4 868 305,01	0,67%
TRESOR	OBLIGATIONS	200134	BDT .10.5%.250000."30/12/2011	40	12 570 377,47	345 751,58	13 830 063,20	734 685,73	0,45%
TRESOR	OBLIGATIONS	200171	BDT .10.25%.250000."21/04/2012	200	65 848 078,00	338 043,62	67 608 724,00	778 354,35	2,18%
TRESOR	OBLIGATIONS	200205	BDT .9.75%.250000."18/08/2012	120	29 987 534,01	351 114,28	42 133 713,60	9 611 179,59	1,36%
TRESOR	OBLIGATIONS	200212	BDT .9.75%.250000."08/09/2012	40	9 993 915,34	350 260,86	14 010 434,40	3 225 685,73	0,45%
TRESOR	OBLIGATIONS	200223	BDT .9.75%.250000."06/10/2012	80	19 989 908,54	349 123,57	27 929 885,60	6 509 977,06	0,90%
TRESOR	OBLIGATIONS	200225	BDT .9.75%.250000."13/10/2012	80	19 990 428,40	348 838,35	27 907 068,00	6 524 556,28	0,90%
TRESOR	OBLIGATIONS	200266	BDT .8.1%.250000."17/08/2008	160	40 990 134,00	292 357,18	46 777 148,80	2 973 097,00	1,51%
TRESOR	OBLIGATIONS	200335	BDT .6.25%.250000."20/03/2015	27	6 300 797,79	293 514,48	7 924 890,96	1 506 199,34	0,26%
TRESOR	OBLIGATIONS	200388	BDT .7.25%.250000."02/10/2020	16	3 818 617,26	332 996,93	5 327 950,88	1 293 444,73	0,17%
TRESOR	OBLIGATIONS	200410	BDT .6.7%.250000."11/12/2010	135	33 513 473,25	290 376,57	39 200 836,95	4 442 127,41	1,26%
TRESOR	OBLIGATIONS	200450	BDT .6.45%.250000."16/04/2011	800	201 563 945,39	283 494,35	226 795 480,00	22 580 849,81	7,30%
TRESOR	OBLIGATIONS	200544	BDT .6.2%.100000."19/12/2006	704	70 650 265,38	104 855,97	73 818 602,88	860 374,81	2,38%
TRESOR	OBLIGATIONS	200554	BDT .7.10%.100000."04/02/2017	1203	124 729 288,22	126 712,94	152 435 666,82	24 289 858,60	4,91%
TRESOR	OBLIGATIONS	200557	BDT .6.70%.100000."18/02/2012	750	82 905 765,00	117 164,22	87 873 165,00	3 150 139,80	2,83%
TRESOR	OBLIGATIONS	200588	BDT .6.90%.100000."14/10/2017	2551	291 581 659,04	127 672,32	325 692 088,32	21 620 314,15	10,48%
TRESOR	OBLIGATIONS	200615	BDT .5.90%.100000."06/01/2013	184	19 316 514,17	114 483,81	21 065 021,04	1 228 013,72	0,68%
TRESOR	OBLIGATIONS	200693	BDT .4.70%.100000."19/01/2009	303	30 620 289,66	105 471,18	31 957 767,54	705 411,61	1,03%
TRESOR	OBLIGATIONS	200697	BDT .4.60%.100000."16/03/2009	2000	200 000 000,00	104 596,75	209 193 500,00	6 521 719,20	6,73%
TRESOR	OBLIGATIONS	200706	BDT .4.50%.100000."04/05/2009	2121	212 157 245,79	103 794,83	220 148 834,43	6 501 077,74	7,09%
TRESOR	OBLIGATIONS	200707	BDT .5.20%.100000."05/04/2014	550	57 421 801,45	109 261,19	60 093 654,50	1 997 990,08	1,93%
TRESOR	OBLIGATIONS	200708	BDT .5.80%.100000."05/04/2019	1701	182 763 659,69	114 534,61	194 823 371,61	9 735 167,33	6,27%
TRESOR	OBLIGATIONS	200713	BDT .4.30%.100000."20/07/2009	1385	140 455 829,69	106 705,21	147 786 715,85	1 701 715,01	4,76%
TRESOR	OBLIGATIONS	200714	BDT .5.15%.100000."14/06/2014	1150	119 504 385,15	107 965,26	124 160 049,00	4 396 047,44	4,00%
TRESOR	OBLIGATIONS	200720	BDT .5.60%.100000."02/08/2019	1152	118 580 404,32	116 239,58	133 907 996,16	9 459 651,05	4,31%
TRESOR	OBLIGATIONS	200750	BDT .5.50%.100000."28/02/2006	150	16 066 943,86	111 721,87	16 758 280,50	415 583,22	0,54%
TRESOR	OBLIGATIONS	200751	BDT .6,00%.100000."28/02/2025	2050	205 008 017,46	116 124,23	238 054 671,50	28 935 421,27	7,66%
TRESOR	OBLIGATIONS	200768	BDT .4.75%.100000."14/11/2015	900	90 125 996,85	107 549,97	96 794 973,00	3 998 565,27	3,12%
TRESOR	OBLIGATIONS	200775	BDT .4.70%.100000."30/01/2016	1145	117 650 545,36	106 042,16	121 418 273,20	1 541 408,73	3,91%
OFFICE NATIONAL DE L'ELECTRICITE	OBLIGATIONS PRIVEES	792091	OBL.12.75%.100000."04/12/2007	20	249 819,40	14 302,05	286 041,00	16 765,07	0,01%
Total prix de revient :	2 791 951 308,35	Total valorisation :	3 106 734 107,24	Total + ou - values:	238 851 179,50	Somme % par rapport au total:	100,00%		
	BANQUE	51400	LIQUIDITE				0,00		0,00%
Total prix de revient :		Total valorisation :	0,00	Total + ou - values:		Somme % par rapport au total:	0,00%		

Emetteur	Nature titre	Code valeur	Libellée valeur	Quantité	Prix revient	Cours	Valorisation	+ ou - Values	% / total
----------	--------------	-------------	-----------------	----------	--------------	-------	--------------	---------------	-----------

Total Général:									
Prix de revient :	2 791 951 308,35	Valorisation :	3 106 734 107,24	+ ou - values:	238 851 179,50	% par rapport au total:	100,00%		

Dépositaire : ATTIJARIWAFI BANK

Ahmed BOUDI
 Attijariwafa bank
 Conciliation Devises, Titres et
 Contrôle dépositaire CPCVM



Abdouk BOUDERS
