



STC / SUPPORTS

CCD, Titres et Contrôle Dépositaire d'OPCVM

OPCVM : Wafa Assurance Securite

Gestionnaire : GESTFONDS

ANNEXE 4
INVENTAIRE DES ACTIFS (EN DH)
(Hors Actif Immobilisé)

Date d'inventaire : 31/12/2006
Dépositaire : ATTIJARIWAFABANK

TITRES A DETAILLER ET A CLASSER PAR EMETTEUR ET PAR NATURE

Emetteurs	Code Maroclear	Désignation	Quantité (A)	Valorisation par titre en DH (C)	Valorisation globale en DH (D=C*A)	% par rapport au total Actif
CIH	2039	OBL. 10.5%.150000."28/07/2010	61,00	41 795,07	2 549 499,27	0,07%
CIH	2067	OBL. 8.5%.15000."22/03/2014	1 481,00	9 842,23	14 576 342,63	0,40%
CIH	2040	OBL. 10.5%.100000."30/08/2010	50,00	27 610,19	1 380 509,50	0,04%
CIH	2035	OBL. 11%.150000."01/12/2009	30,00	30 271,23	908 136,90	0,02%
CIH	2033	OBL. 11%.150000."25/08/2009	60,00	31 157,26	1 869 435,60	0,05%
CIH	2031	OBL. 11%.200000."12/05/2009	13,00	46 605,63	605 873,19	0,02%
CIH	2030	OBL. 12.75%.200000."24/12/2008	30,00	26 731,92	801 957,60	0,02%
CIH	2029	OBL. 12.75%.200000."18/11/2008	25,00	27 067,26	676 681,50	0,02%
CIH	2027	OBL. 12.75%.200000."30/09/2008	30,00	27 523,70	825 711,00	0,02%
CIH	2024	OBL. 12.75%.150000."28/05/2008	10,00	21 516,03	215 160,30	0,01%
CIH	2023	OBL. 12.75%.150000."26/04/2008	7,00	21 739,59	152 177,13	0,00%
CIH	2022	OBL. 12.75%.150000."22/03/2008	40,00	21 984,11	879 364,40	0,02%
CIH	2041	OBL. 10.5%.150000."29/09/2010	200,00	41 070,14	8 214 028,00	0,22%
CIH	2028	OBL. 12.75%.150000."29/10/2008	14,00	20 440,14	286 161,96	0,01%
FONDS D'EQUIPEMENT COMMUNAL	2005	OBL. 12.75%.150000."19/11/2007	14,00	10 146,71	142 053,94	0,00%
FONDS D'EQUIPEMENT COMMUNAL	2004	OBL. 12.75%.150000."16/10/2007	28,00	10 265,48	287 433,44	0,01%
OFFICE NATIONAL DE L'ELECTRICITE	792091	OBL. 12.75%.100000."04/12/2007	20,00	6 729,50	134 590,00	0,00%

Emetteurs	Code Maroclear	Désignation	Quantité (A)	Valorisation par titre en DH (C)	Valorisation globale en DH (D=C*A)	% par rapport au total Actif
ONCF	9004	OBL.6.95%.150000."28/05/2017	515,00	132 610,43	68 294 371,45	1,87%
ONCF	9056	OBL.4,15%.100000."20/12/2021	310,00	100 918,81	31 284 831,10	0,86%
TRESOR	200171	BDT .10.25%.250000."21/04/2012	200,00	353 592,18	70 718 436,00	1,93%
TRESOR	200205	BDT .9.75%.250000."18/08/2012	120,00	342 952,84	41 154 340,80	1,13%
TRESOR	200063	BDT .10.5%.500000."08/04/2011	58,00	684 906,22	39 724 560,76	1,09%
TRESOR	200068	BDT .10.5%.500000."22/04/2011	16,00	684 059,23	10 944 947,68	0,30%
TRESOR	200075	BDT .10.5%.500000."10/06/2011	46,00	681 102,41	31 330 710,86	0,86%
TRESOR	200085	BDT .10.5%.500000."22/07/2011	42,00	678 564,84	28 499 723,28	0,78%
TRESOR	200088	BDT .10.5%.500000."12/08/2011	40,00	677 297,08	27 091 883,20	0,74%
TRESOR	200094	BDT .10.5%.250000."02/09/2011	70,00	338 014,60	23 661 022,00	0,65%
TRESOR	200109	BDT .10.5%.250000."14/10/2011	60,00	336 745,24	20 204 714,40	0,55%
TRESOR	200120	BDT .10.5%.250000."11/11/2011	60,00	335 899,76	20 153 985,60	0,55%
TRESOR	200054	BDT .10.5%.1000000."19/02/2011	34,00	688 016,03	23 392 545,02	0,64%
TRESOR	200693	BDT .4.70%.100000."19/01/2009	303,00	107 968,25	32 714 379,75	0,89%
TRESOR	200802	BDT.4,50%.100000."04/12/2036	390,00	109 516,88	42 711 583,20	1,17%
TRESOR	200779	BDT.3.90%.100000."06/03/2011	857,00	106 447,76	91 225 730,32	2,50%
TRESOR	200775	BDT.4.70%.100000."30/01/2016	1 145,00	114 295,00	130 867 775,00	3,58%
TRESOR	200773	BDT.5.30%.100000."02/01/2021	1 000,00	123 718,19	123 718 190,00	3,38%
TRESOR	200771	BDT.3.95%.100000."17/01/2011	1 497,00	107 640,96	161 138 517,12	4,41%
TRESOR	200768	BDT.4.75%.100000."14/11/2015	900,00	111 328,57	100 195 713,00	2,74%
TRESOR	200751	BDT.6,00%.100000."28/02/2025	2 050,00	133 984,70	274 668 635,00	7,51%
TRESOR	200750	BDT.5.50%.100000."28/02/2020	1 150,00	124 409,50	143 070 925,00	3,91%
TRESOR	200731	BDT.4,00%.100000."18/10/2009	1 658,00	103 646,51	171 845 913,58	4,70%
TRESOR	200720	BDT .5.60%.100000."02/08/2019	1 152,00	122 906,40	141 588 172,80	3,87%
TRESOR	200714	BDT .5.15%.100000."14/06/2014	1 150,00	115 207,57	132 488 705,50	3,62%
TRESOR	200713	BDT .4.30%.100000."20/07/2009	1 385,00	105 293,82	145 831 940,70	3,99%
TRESOR	200134	BDT .10.5%.250000."30/12/2011	40,00	334 418,63	13 376 745,20	0,37%
TRESOR	200707	BDT .5.20%.100000."05/04/2014	550,00	116 347,98	63 991 389,00	1,75%

Emetteurs	Code Maroclear	Désignation	Quantité (A)	Valorisation par titre en DH (C)	Valorisation globale en DH (D=C*A)	% par rapport au total Actif
TRESOR	200410	BDT .6.70%.250000."11/12/2010	135,00	284 710,45	38 435 910,75	1,05%
TRESOR	200212	BDT .9.75%.250000."08/09/2012	40,00	342 289,84	13 691 593,60	0,37%
TRESOR	200223	BDT .9.75%.250000."06/10/2012	80,00	341 407,93	27 312 634,40	0,75%
TRESOR	200225	BDT .9.75%.250000."13/10/2012	80,00	341 187,46	27 294 996,80	0,75%
TRESOR	200266	BDT .8.10%.250000."17/08/2008	160,00	277 813,14	44 450 102,40	1,22%
TRESOR	200708	BDT .5.80%.100000."05/04/2019	1 701,00	126 694,38	215 507 140,38	5,89%
TRESOR	200388	BDT .7.25%.250000."02/10/2020	16,00	352 184,03	5 634 944,48	0,15%
TRESOR	200450	BDT .6.45%.250000."16/04/2011	800,00	294 926,31	235 941 048,00	6,45%
TRESOR	200554	BDT .7.10%.100000."04/02/2017	843,00	137 798,90	116 164 472,70	3,18%
TRESOR	200557	BDT .6.70%.100000."18/02/2012	750,00	122 560,81	91 920 607,50	2,51%
TRESOR	200597	BDT .5.85%.100000."02/12/2012	1 000,00	114 777,49	114 777 490,00	3,14%
TRESOR	200615	BDT .5.90%.100000."06/01/2013	184,00	120 568,85	22 184 668,40	0,61%
TRESOR	200335	BDT .6.25%.250000."20/03/2015	27,00	314 642,24	8 495 340,48	0,23%
	51400	LIQUIDITE			1 073 894,24	0,03%
	60	Dépôt à terme			451 681 906,09	12,35%
AUTRES ACTIFS	32200	COUPON A RECEVOIR			1 050 000,00	0,03%
AUTRES ACTIFS	32200	COUPON A RECEVOIR			0,00	0,00%

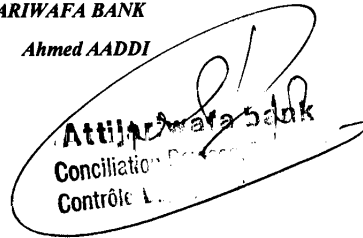
Emetteurs	Code Maroclear	Désignation	Quantité (A)	Valorisation par titre en DH (C)	Valorisation globale en DH (D=C*A)	% par rapport au total Actif
Total actifs					3 656 012 253,90	100,00%

Dépositaire : **ATTIJARIWAFI BANK**

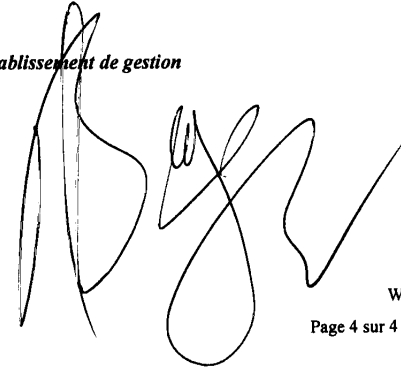
Abdelhak **BOUDERS**



Ahmed **AADDI**



Etablissement de gestion



WAFI ASSURANCE SECURITE



التجاريف و فابانك
Attijariwafa bank

ANNEXE 4 BIS

COMPLEMENT D'INFORMATION RELATIVES A L'INVENTAIRE DES ACTIFS

(Hors Actif Immobilisé)

STC / SUPPORTS

CCD, Titres et Contrôle Dépositaire d'OPCVM

OPCVM Wafa ASSURANCE SECURITE

Gestionnaire GESTFONDS

Date d'inventaire 31/12/2006

Dépositaire: ATTJARIWafa BANK

Pensions livrées	-485 663 142,70
Actifs Net	3 168 866 113,57
Nombre d'actions ou de parts	135 617,199

Dépositaire : ATTJARIWafa BANK

Abdelhak BOUDERS

Ahmed AADDI

Etablissement de gestion

Attijariwafa bank
Conciliation, Devises, Titres et
Contrôle Dépositaire OPCVM