



ABC ARBITRAGE

Société anonyme au capital de 953 742.00 euros
Siège social : 18 rue du Quatre-Septembre - 75002 PARIS
400 343 182 RCS Paris

Paris, 1er juillet 2024

Bilan semestriel du contrat de liquidité de la société ABC ARBITRAGE

Au titre du contrat de liquidité confié par la société ABC ARBITRAGE à Kepler Cheuvreux, à la date du 30 juin 2024, les moyens suivants figuraient au compte de liquidité :

- 86 543 titres
- 33 745.52 € en espèces

- Nombre de transactions exécutées sur le semestre à l'achat : 495
- Nombre de transactions exécutées sur le semestre à la vente : 475
- Volume échangé sur le semestre à l'achat : 127 737 titres pour 520 979.38 €
- Volume échangé sur le semestre à la vente : 114 132 titres pour 470 165.01 €

Il est rappelé :

- que lors du dernier bilan du 31 décembre 2023, les moyens suivants figuraient au compte de liquidité :
 - 72 938 titres
 - 83 483.07 € en espèces

 - Nombre de transactions exécutées sur le semestre à l'achat : 383
 - Nombre de transactions exécutées sur le semestre à la vente : 388
 - Volume échangé sur le semestre à l'achat : 63 601 titres pour 348 082.55 €
 - Volume échangé sur le semestre à la vente : 42 073 titres pour 237 899.10 €

- que lors de la mise en place du contrat, les moyens suivants figuraient au compte de liquidité :
 - 28 440 titres
 - 49 007.93 € en espèces

La mise en œuvre du présent bilan est réalisée conformément à la décision AMF n°2021-01 du 22 juin 2021 renouvelant l'instauration des contrats de liquidité sur titres de capital au titre de pratique de marché admise.

	Achats			Ventes		
	Nombre de transactions	Nombre de titres	Capitaux en EUR	Nombre de transactions	Nombre de titres	Capitaux en EUR
Total	495	127 737	520 979.38	475	114 132	470 165.01
02/01/2024	7	1 200	5 724.00	-	-	-
03/01/2024	5	900	4 248.00	3	300	1 428.00
04/01/2024	3	729	3 411.72	2	600	2 832.00
05/01/2024	8	921	4 282.65	5	900	4 221.00
08/01/2024	-	-	-	20	3 000	14 400.00
09/01/2024	9	1 400	6 622.00	-	-	-
10/01/2024	3	900	4 248.00	2	600	2 862.00
11/01/2024	-	-	-	10	1 100	5 280.00
12/01/2024	-	-	-	2	300	1 446.00
15/01/2024	1	500	2 400.00	12	288	1 388.16
16/01/2024	15	2 000	9 500.00	-	-	-
17/01/2024	2	600	2 802.00	-	-	-
18/01/2024	3	900	4 185.00	-	-	-
19/01/2024	3	600	2 772.00	1	1	4.70
22/01/2024	-	-	-	5	1 300	5 980.00
23/01/2024	2	500	2 300.00	2	1 000	4 620.00
24/01/2024	5	1 000	4 540.00	-	-	-
25/01/2024	4	1 200	5 388.00	-	-	-
26/01/2024	-	-	-	7	600	2 676.00
30/01/2024	8	1 000	4 420.00	3	300	1 350.00
31/01/2024	3	600	2 598.00	6	2 000	8 860.00
01/02/2024	4	1 001	4 344.34	-	-	-
02/02/2024	6	1 200	5 112.00	-	-	-
05/02/2024	10	1 800	7 416.00	-	-	-
06/02/2024	2	600	2 400.00	8	3 000	12 360.00
07/02/2024	-	-	-	24	10 000	42 800.00
08/02/2024	-	-	-	6	2 000	8 640.00
09/02/2024	-	-	-	3	500	2 175.00
12/02/2024	16	2 000	8 660.00	4	1 003	4 433.26
13/02/2024	11	3 820	15 967.60	-	-	-
14/02/2024	21	3 990	15 840.30	-	-	-
15/02/2024	1	500	1 950.00	7	1 500	6 015.00
16/02/2024	10	2 500	9 850.00	-	-	-
19/02/2024	7	2 000	7 980.00	10	1 500	6 030.00
20/02/2024	21	2 000	7 880.00	8	1 501	5 943.96
21/02/2024	11	4 000	15 440.00	-	-	-
22/02/2024	6	2 000	7 420.00	-	-	-
23/02/2024	4	2 000	7 280.00	7	1 544	5 651.04
26/02/2024	3	1 000	3 670.00	7	1 956	7 335.00
27/02/2024	3	1 000	3 720.00	3	1 000	3 850.00
28/02/2024	3	1 500	5 625.00	1	500	1 945.00
29/02/2024	5	2 000	7 280.00	-	-	-
01/03/2024	2	500	1 900.00	15	5 000	19 400.00
04/03/2024	14	3 500	13 090.00	5	2 000	7 680.00
05/03/2024	5	1 500	5 535.00	-	-	-
06/03/2024	-	-	-	6	3 000	11 250.00
07/03/2024	-	-	-	6	1 500	5 670.00
08/03/2024	1	475	1 776.50	-	-	-
11/03/2024	8	751	2 831.27	10	2 000	7 620.00
12/03/2024	1	250	950.00	2	750	2 917.50
13/03/2024	4	2 000	7 660.00	-	-	-

	Achats			Ventes		
	Nombre de transactions	Nombre de titres	Capitaux en EUR	Nombre de transactions	Nombre de titres	Capitaux en EUR
Total	495	127 737	520 979.38	475	114 132	470 165.01
14/03/2024	-	-	-	2	500	1 950.00
15/03/2024	-	-	-	12	3 910	15 405.40
19/03/2024	-	-	-	9	3 000	12 090.00
20/03/2024	-	-	-	3	1 000	4 090.00
21/03/2024	2	500	2 000.00	-	-	-
22/03/2024	7	2 000	8 200.00	3	500	2 050.00
26/03/2024	20	8 500	32 810.00	-	-	-
27/03/2024	-	-	-	10	3 000	11 580.00
28/03/2024	6	1 000	3 820.00	4	1 500	5 775.00
02/04/2024	-	-	-	14	1 500	5 955.00
03/04/2024	-	-	-	13	4 000	16 200.00
04/04/2024	3	500	2 015.00	6	500	2 025.00
05/04/2024	7	3 000	12 000.00	-	-	-
08/04/2024	-	-	-	11	1 500	6 165.00
09/04/2024	2	500	2 025.00	2	500	2 050.00
10/04/2024	4	1 500	6 075.00	1	500	2 050.00
11/04/2024	-	-	-	1	500	2 050.00
12/04/2024	-	-	-	4	500	2 050.00
15/04/2024	2	500	2 005.00	3	750	3 015.00
16/04/2024	10	2 000	7 920.00	-	-	-
17/04/2024	1	500	1 975.00	2	500	2 000.00
18/04/2024	-	-	-	10	1 250	5 037.50
19/04/2024	1	500	1 990.00	-	-	-
25/04/2024	3	500	1 950.00	-	-	-
26/04/2024	-	-	-	4	1 500	5 955.00
29/04/2024	2	1 000	4 000.00	7	1 500	6 015.00
30/04/2024	2	1 500	5 925.00	-	-	-
02/05/2024	-	-	-	8	769	3 114.45
03/05/2024	5	1 000	4 010.00	-	-	-
06/05/2024	4	1 000	4 020.00	2	1 000	4 060.00
07/05/2024	3	2 500	10 050.00	-	-	-
08/05/2024	7	1 000	3 990.00	-	-	-
09/05/2024	-	-	-	4	500	2 000.00
10/05/2024	1	500	2 000.00	6	1 457	5 871.71
13/05/2024	-	-	-	24	5 500	22 715.00
14/05/2024	12	2 500	10 325.00	1	500	2 090.00
15/05/2024	2	1 500	6 180.00	-	-	-
16/05/2024	1	500	2 060.00	3	500	2 090.00
17/05/2024	2	500	2 080.00	-	-	-
20/05/2024	5	2 000	8 360.00	5	1 500	6 330.00
21/05/2024	3	500	2 075.00	-	-	-
22/05/2024	-	-	-	6	1 500	6 315.00
23/05/2024	1	1 000	4 200.00	1	3	12.72
24/05/2024	1	500	2 090.00	4	1 000	4 220.00
27/05/2024	6	3 500	14 700.00	4	2 000	8 520.00
28/05/2024	-	-	-	6	877	3 709.71
29/05/2024	9	2 500	10 500.00	2	460	1 955.00
30/05/2024	3	1 500	6 390.00	6	1 500	6 405.00
31/05/2024	8	1 000	4 230.00	4	500	2 140.00
03/06/2024	4	500	2 150.00	9	2 000	8 660.00
04/06/2024	6	2 000	8 600.00	1	500	2 175.00

	Achats		
	Nombre de transactions	Nombre de titres	Capitaux en EUR
Total	495	127 737	520 979.38
05/06/2024	2	500	2 170.00
06/06/2024	7	1 000	4 340.00
07/06/2024	-	-	-
10/06/2024	5	2 000	8 640.00
11/06/2024	5	1 500	6 360.00
12/06/2024	18	2 500	10 425.00
13/06/2024	12	2 500	10 225.00
14/06/2024	1	400	1 600.00
17/06/2024	5	1 500	5 925.00
18/06/2024	-	-	-
19/06/2024	-	-	-
20/06/2024	1	500	2 000.00
21/06/2024	5	2 000	8 000.00
24/06/2024	6	1 500	5 850.00
25/06/2024	9	1 500	5 895.00
26/06/2024	-	-	-
27/06/2024	2	500	1 940.00
28/06/2024	2	1 000	3 870.00

	Ventes		
	Nombre de transactions	Nombre de titres	Capitaux en EUR
	475	114 132	470 165.01
	5	500	2 195.00
	-	-	-
	3	1 000	4 420.00
	-	-	-
	1	10	43.20
	2	1 000	4 190.00
	-	-	-
	-	-	-
	2	750	2 970.00
	6	1 500	6 000.00
	4	1 000	4 050.00
	11	1 500	6 075.00
	-	-	-
	7	3 000	11 940.00
	-	-	-
	4	525	2 047.50
	-	-	-
	1	328	1 279.20