

Ofi Invest ISR Monétaire CT

Fonds Commun de Placement

Société de Gestion :

OFI Invest Asset Management

127-129, quai du Président Roosevelt

92130 ISSY LES MOULINEAUX

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

au 30 juin 2026

Ofi Invest ISR Monétaire CT

Fonds Commun de Placement

Société de Gestion :
OFI Invest Asset Management

127-129, quai du Président Roosevelt
92130 ISSY LES MOULINEAUX

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

au 30 juin 2026

En notre qualité de commissaire aux comptes du Fonds Commun de Placement Ofi Invest ISR Monétaire CT et en application des dispositions prévues par l'article L214-24-49 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 2026 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 du fonds Ofi Invest ISR Monétaire CT 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 intervention. 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 du fonds Ofi Invest ISR Monétaire CT acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

A Paris La Défense, le 25 août 2026

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés



Atsou DOH

Inventaire du portefeuille OFI INVEST ISR MONÉTAIRE CT

au 30/06/2026

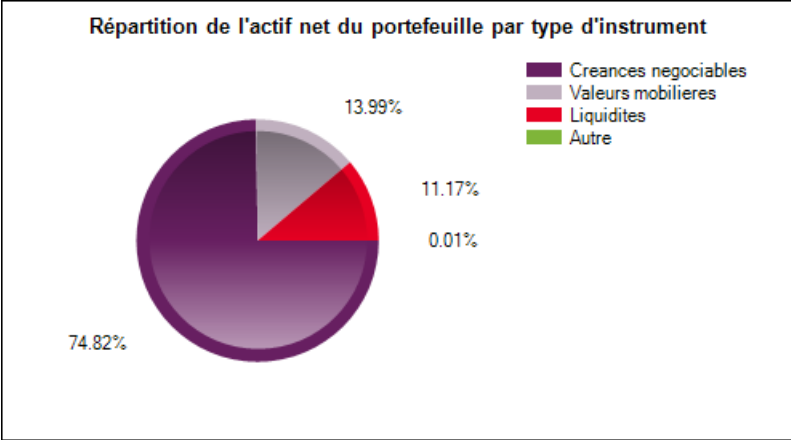
▼ Descriptif du portefeuille

Libellé	Code	Actif net	Dev	Statut VL
OFI INVEST ISR MONÉTAIRE CT	FAMZ18	4 244 571 541,81 EUR		OFF

▼ Synthèse

Part	Code ISIN	VL	Actif de la part	Dev	Nombre de parts
C	FR0000985558	2 458,32	3 627 504 983,87000	EUR	1 475 601,4741
CP	FR001400CQH6	111,44	178 251 586,04000	EUR	1 599 521,5426
D	FR0010510479	9 922,16	410 375,83000	EUR	41,3595
E	FR0010738229	1 120,77	11 702 198,45000	EUR	10 441,1727
F	FR0010694125	3 414,70	426 702 397,62000	EUR	124 960,3823

Valeur boursière	Prix de revient	+/- value	Intérêts courus
Valeurs mobilières			
594 017 037,17	590 699 965,67	1 254 909,66	2 062 161,84
Creances negociables			
3 175 808 900,89	3 160 938 853,20	8 459 014,30	6 411 033,39
Swap de Taux			
625 701,59		677 552,86	-51 851,27
Liquidités			
474 119 902,16	473 541 008,09	-4,17	578 898,24
Total			
4 244 571 541,81	4 225 179 826,96	10 391 472,65	9 000 242,20



v Détails

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
Valeurs mobilières										
Obligation										
XS1114159277	ADIDAS AG 2.25% 08/10/2026	2 214 000,000	99,91000	EUR	29/06/2026	2 211 786,00	2 248 174,45	36 167,05	221,40	0,05
XS2101349723	BANCO BILBAO VIZCAYA ARG 0.5% 14/01/2027	4 000 000,000	98,87400	EUR	29/06/2026	3 933 200,00	3 964 110,68	9 150,68	21 760,00	0,09
XS2625968693	BMW FINANCE NV 3.25% 22/11/2026	30 000 000,000	100,26200	EUR	29/06/2026	30 224 100,00	30 666 271,23	587 671,23	-145 500,00	0,72
FR0013444759	BNP PARIBAS 0.125% 04/09/2026	15 000 000,000	99,57900	EUR	29/06/2026	14 795 839,00	14 952 209,59	15 359,59	141 011,00	0,35
XS2723549528	CIE DE SAINT GOBAIN SA 3.75% 29/11/2026	19 900 000,000	100,35000	EUR	29/06/2026	20 005 100,00	20 405 132,88	435 482,88	-35 450,00	0,48
XS2168478068	CRH SMW FINANCE DAC 1.25% 05/11/2026	8 000 000,000	99,49100	EUR	29/06/2026	7 954 000,00	8 024 211,51	64 931,51	5 280,00	0,19
XS2535484526	ESSITY CAPITAL BV 3% 21/09/2026	10 000 000,000	100,05650	EUR	30/06/2026	10 005 649,30	10 239 074,66	233 424,66	0,70	0,24
XS1945110606	IBM 1 1/4 01/29/27 1.25% 29/01/2027	3 124 000,000	99,17800	EUR	29/06/2026	3 094 254,40	3 114 582,64	16 261,92	4 066,32	0,07
FR0013433596	LA BANQUE POSTALE 0.25% 12/07/2026	8 800 000,000	100,02800	EUR	29/06/2026	8 689 395,00	8 823 740,71	21 276,71	113 069,00	0,21
FR0013508686	LA POSTE SA 0.625% 21/10/2026	9 400 000,000	99,45800	EUR	29/06/2026	9 292 370,00	9 389 613,64	40 561,64	56 682,00	0,22
XS1196503137	PRICELINE GROUP INC THE 1.8% 03/03/2027	12 500 000,000	99,37500	EUR	29/06/2026	12 408 500,00	12 495 231,16	73 356,16	13 375,00	0,29
XS3373518086	ROYAL BANK OF CANADA VAR 13/05/2027	30 255 000,000	100,03050	EUR	30/06/2026	30 255 000,00	30 356 285,67	92 057,90	9 227,77	0,72
FR0013430733	SOCIETE GENERALE 0.875% 01/07/2026	4 100 000,000	100,00000	EUR	29/06/2026	4 074 420,00	4 135 776,71	35 776,71	25 580,00	0,10
FR001400U1B5	SOCIETE GENERALE 3% 12/02/2027	12 000 000,000	100,18400	EUR	29/06/2026	12 082 170,00	12 158 189,59	136 109,59	-60 090,00	0,29
FR001400KZP3	SOCIETE GENERALE 4.25% 28/09/2026	7 800 000,000	100,41900	EUR	29/06/2026	7 947 936,00	8 082 442,27	249 760,27	-115 254,00	0,19
FR0014006XA3	SOCIETE GENERALE VAR 02/12/2027	4 100 000,000	99,14000	EUR	29/06/2026	4 064 870,00	4 079 553,34	14 813,34	-130,00	0,10
Total Obligation						181 038 589,70	183 134 600,73	2 062 161,84	33 849,19	4,31
Sicav (O.P.C.V.M.)										
FR0013067808	BFT MONETARIE COURT TERME ISR C LIMAT SICAV	18 896,000	10 865,71000	EUR	29/06/2026	204 852 938,78	205 318 456,16		465 517,38	4,84
FR001400R6M6	OSTRUM SRI CASH PLUS SICAV	782,000	262 869,54000	EUR	29/06/2026	204 808 437,19	205 563 980,28		755 543,09	4,84
Total Sicav (O.P.C.V.M.)						409 661 375,97	410 882 436,44		1 221 060,47	9,68
Total Valeurs mobilières						590 699 965,67	594 017 037,17	2 062 161,84	1 254 909,66	13,99
Creances negociables										
Interets postcomptes.										
FR0129784395	AGENCE CENTRALE DES OR OISEST+0.21% 30/10/2026	30 000 000,000	99,99200	EUR	30/06/2026	30 000 000,00	30 009 559,50	11 959,50	-2 400,00	0,71
FR0129753648	AXA BANQUE SA OISEST + 0.15% 15/07/2026	10 000 000,000	100,00150	EUR	30/06/2026	10 000 000,00	10 028 902,00	28 752,00	150,00	0,24
FR0129753655	AXA BANQUE SA OISEST + 0.2% 14/09/2026	15 000 000,000	100,00120	EUR	30/06/2026	15 000 000,00	15 044 308,00	44 128,00	180,00	0,35
FR0129753671	AXA BANQUE SA OISEST + 0.32% 13/05/2027	25 000 000,000	99,99260	EUR	30/06/2026	25 000 000,00	25 075 696,67	77 546,67	-1 850,00	0,59
FR0129714913	AXA BANQUE S.A. OISEST +.19% 05/08/2026	20 000 000,000	100,00640	EUR	30/06/2026	20 000 000,00	20 070 478,00	69 198,00	1 280,00	0,47

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
FR0129808897	BANQUE FEDERA OISEST+0.34% 01/06/2027	15 000 000,000	99,98540	EUR	30/06/2026	15 000 000,00	15 004 114,75	6 304,75	-2 190,00	0,35
FR0129677102	BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT OISEST +0.3% 02/12/202	10 000 000,000	100,02210	EUR	30/06/2026	10 000 000,00	10 059 077,50	56 867,50	2 210,00	0,24
FR0129488716	BANQUE FEDERATIVE DU OISEST + 0.33% 13/11/2026	10 000 000,000	100,03110	EUR	30/06/2026	10 000 000,00	10 149 287,78	146 177,78	3 110,00	0,24
FR0129672038	BANQUE FEDERATIVE DU OISEST+0.30% 11/12/2026	20 000 000,000	100,02160	EUR	30/06/2026	20 000 000,00	20 142 962,78	138 642,78	4 320,00	0,47
FR0129676880	BANQUE FEDERATIVE DU OISEST+0.35% 01/04/2027	15 000 000,000	100,01390	EUR	30/06/2026	15 000 000,00	15 090 214,71	88 129,71	2 085,00	0,36
FR0129499382	BANQUE PALATINE SA OISEST +0.33% 13/11/2026	25 000 000,000	100,03710	EUR	30/06/2026	25 000 000,00	25 373 130,56	363 855,56	9 275,00	0,60
FR0129673788	BFCM OISEST +.34% 20/01/2027	10 000 000,000	100,03600	EUR	30/06/2026	10 000 000,00	10 069 703,11	66 103,11	3 600,00	0,24
FR0129439719	BPCE OISEST .3% 15/09/2026	25 000 000,000	100,03350	EUR	30/06/2026	25 000 000,00	25 414 411,46	406 036,46	8 375,00	0,60
FR0129266872	BPCE SA OISEST + 0.32% 10/07/2026	20 000 000,000	100,00720	EUR	30/06/2026	20 000 000,00	20 450 554,44	449 114,44	1 440,00	0,48
FR0129705952	BPCE SA OISEST +.33% 23/03/2027	15 000 000,000	100,02630	EUR	30/06/2026	15 000 000,00	15 070 509,88	66 564,88	3 945,00	0,36
FR0129787802	BPCE SA OISEST+0.34% 04/06/2027	20 000 000,000	100,00440	EUR	30/06/2026	20 000 000,00	20 035 649,22	34 769,22	880,00	0,47
FR0129621944	CA CONSUMER FINANCE OISEST + 0.35% 05/02/2027	20 000 000,000	100,01100	EUR	30/06/2026	20 000 000,00	20 179 599,00	177 399,00	2 200,00	0,48
FR0129654705	CA CONSUMER FINANCE SA OISEST +0.23% 06/08/2026	20 000 000,000	100,00150	EUR	30/06/2026	20 000 000,00	20 143 118,00	142 818,00	300,00	0,47
FR0129787877	CREDIT AGRICOLE OISEST+0.37% 04/06/2027	20 000 000,000	99,99870	EUR	30/06/2026	20 000 000,00	20 034 942,56	35 202,56	-260,00	0,47
FR0129548600	CREDIT AGRICOLE SA OISEST + 0.33% 15/12/2026	30 000 000,000	100,02000	EUR	30/06/2026	30 000 000,00	30 338 108,00	332 108,00	6 000,00	0,71
FR0129671907	CREDIT AGRICOLE SA OISEST +0.26% 13/10/2026	15 000 000,000	100,01150	EUR	30/06/2026	15 000 000,00	15 103 873,75	102 148,75	1 725,00	0,36
FR0129671923	CREDIT AGRICOLE SA OISEST+0.27%13/11/2026	15 000 000,000	100,00700	EUR	30/06/2026	15 000 000,00	15 103 657,08	102 607,08	1 050,00	0,36
FR0129671964	CREDIT AGRICOLE SA OISEST+0.31% 13/01/2027	15 000 000,000	100,00170	EUR	30/06/2026	15 000 000,00	15 104 695,42	104 440,42	255,00	0,36
FR0129782829	CREDIT AGRICOLE SA OISEST+0.33% 31/03/2027	15 000 000,000	99,98650	EUR	30/06/2026	15 000 000,00	15 025 831,50	27 856,50	-2 025,00	0,35
FR0129782787	CREDIT AGRICOLE SA OISEST+0.35% 02/06/2027	20 000 000,000	99,98100	EUR	30/06/2026	20 000 000,00	20 033 653,11	37 453,11	-3 800,00	0,47
FR0129653319	CREDIT INDUSTRIEL E OISEST .26% 02/10/2026	10 000 000,000	100,01300	EUR	30/06/2026	10 000 000,00	10 075 523,33	74 223,33	1 300,00	0,24
FR0129653343	CREDIT INDUSTRIEL ET OISEST .32%03/02/2027	20 000 000,000	100,01980	EUR	30/06/2026	20 000 000,00	20 156 406,67	152 446,67	3 960,00	0,47
FR0129417244	CREDIT LYONNAIS OISEST+0.28% 10/07/2026	30 000 000,000	100,00610	EUR	30/06/2026	30 000 000,00	30 494 080,00	492 250,00	1 830,00	0,72
FR0129410561	CREDIT LYONNAIS SA OISEST+0.33% 22/09/2026	30 000 000,000	100,03470	EUR	30/06/2026	30 000 000,00	30 547 902,00	537 492,00	10 410,00	0,72
FR0129806511	DANONE OISEST + 0.3% 16/12/2026	29 000 000,000	100,00910	EUR	30/06/2026	29 000 000,00	29 032 430,46	29 791,46	2 639,00	0,68
FR0129805273	ENGIE OISEST +0.25% 11/09/2026	30 000 000,000	100,00130	EUR	30/06/2026	30 000 000,00	30 037 859,58	37 469,58	390,00	0,71
FR0129788768	ENGIE SA OISEST +0.25% 04/09/2026	40 000 000,000	100,00330	EUR	30/06/2026	40 000 000,00	40 068 258,44	66 938,44	1 320,00	0,94
FR0129756062	ENGIE SA OISEST +.25% 19/06/2026	25 000 000,000	100,00460	EUR	30/06/2026	25 000 000,00	25 065 742,08	64 592,08	1 150,00	0,59
FR0129781268	ING BANK NV OISEST + 0.33% 01/06/2027	30 000 000,000	99,99380	EUR	30/06/2026	30 000 000,00	30 057 627,50	59 487,50	-1 860,00	0,71

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
FR0129808681	ING BANK NV OISEST +0.32% 24/06/2027	10 000 000,000	99,97410	EUR	30/06/2026	10 000 000,00	10 002 274,81	4 864,81	-2 590,00	0,24
FR0129446847	ING BANK NV OISEST+0.30% 22/10/2026	30 000 000,000	100,02840	EUR	30/06/2026	30 000 000,00	30 480 734,67	472 214,67	8 520,00	0,72
FR0129580793	ING BANK OISEST+0.31% 29/12/2026	20 000 000,000	100,02050	EUR	30/06/2026	20 000 000,00	20 197 220,00	193 120,00	4 100,00	0,48
FR0129516672	LA BANQUE POSTALE OISEST +0.215% 30/07/2026	10 000 000,000	100,00820	EUR	30/06/2026	10 000 000,00	10 092 742,00	91 922,00	820,00	0,24
FR0129516698	LA BANQUE POSTALE OISEST +0.295% 29/01/2027	15 000 000,000	100,01240	EUR	30/06/2026	15 000 000,00	15 144 809,67	142 949,67	1 860,00	0,36
FR0129651875	LA BANQUE POSTALE OISEST +0.305% 15/04/2027	20 000 000,000	99,99890	EUR	30/06/2026	20 000 000,00	20 096 304,22	96 524,22	-220,00	0,47
FR0129516185	LA BANQUE POSTALE OISEST+0.3% 04/12/2026	30 000 000,000	100,03170	EUR	30/06/2026	30 000 000,00	30 341 020,67	331 510,67	9 510,00	0,71
FR0129631067	LEGRAND FRANCE OISEST + 0.3% 15/10/2026	10 000 000,000	100,00440	EUR	30/06/2026	10 000 000,00	10 049 217,36	48 777,36	440,00	0,24
FR0129439065	PALATINE SA OISEST +0.33% 14/10/2026	10 000 000,000	100,03650	EUR	30/06/2026	10 000 000,00	10 168 222,92	164 572,92	3 650,00	0,24
FR0129756146	SOCIETE GENERALE OISEST + 0.37% 18/06/2027	30 000 000,000	100,01760	EUR	30/06/2026	30 000 000,00	30 032 926,67	27 646,67	5 280,00	0,71
FR0129634376	SOCIETE GENERALE SA OISEST+0.34% 22/03/2027	20 000 000,000	100,03120	EUR	30/06/2026	20 000 000,00	20 134 645,56	128 405,56	6 240,00	0,47
FR0129781755	VEOLIA ENVIRONNEMENT OISEST+.28% 01/10/2026	40 000 000,000	100,00660	EUR	30/06/2026	40 000 000,00	40 080 290,00	77 650,00	2 640,00	0,94

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
Total Interets postcomptes.						944 000 000,00	950 512 277,39	6 411 033,39	101 244,00	22,39
Interets precomptes.										
XS3325326695	ABN AMRO GROUP BANK NV ZCP 17/07/2026	10 000 000,000	99,89130	EUR	30/06/2026	9 926 379,35	9 989 130,00		62 750,65	0,24
FR0129677722	ACHMEA BANK NV ZCP 06/04/2027	10 000 000,000	97,92570	EUR	30/06/2026	9 713 222,50	9 792 570,00		79 347,50	0,23
FR0129547909	ACHMEA BANK NV ZCP 08/01/2027	9 500 000,000	98,61790	EUR	30/06/2026	9 286 273,83	9 368 700,50		82 426,67	0,22
FR0129672715	ACHMEA BANK NV ZCP 12/03/2027	15 000 000,000	98,12470	EUR	30/06/2026	14 614 185,50	14 718 705,00		104 519,50	0,35
FR0129713618	ACHMEA BANK NV ZCP 29/04/2027	10 000 000,000	97,73970	EUR	30/06/2026	9 722 293,49	9 773 970,00		51 676,51	0,23
BE6366634390	AEDIFICA ZCP 29/07/2026	20 000 000,000	99,80500	EUR	30/06/2026	19 959 747,84	19 961 000,00		1 252,16	0,47
FR0129632438	AGACHE SOCIETE FINANCIERE ZCP 14/08/2026	35 000 000,000	99,69850	EUR	30/06/2026	34 793 755,18	34 894 475,00		100 719,82	0,82
FR0129716249	AG.CENT.DES ORG.DE SECUR.SOC. ZCP 26/08/2026	30 000 000,000	99,62900	EUR	30/06/2026	29 822 234,63	29 888 700,00		66 465,37	0,70
XS3371229066	AGENCE CENTRALE ORGANISMES ZCP 06/08/2026	15 000 000,000	99,76260	EUR	30/06/2026	14 912 727,41	14 964 390,00		51 662,59	0,35
FR0129632875	BANCO BILBAO VIZCAY ZCP 14/05/2027	15 000 000,000	97,60530	EUR	30/06/2026	14 575 201,70	14 640 795,00		65 593,30	0,34
XS3398399058	BANCO BILBAO VIZCAY ZCP 31/05/2027	30 000 000,000	97,51190	EUR	30/06/2026	29 165 446,94	29 253 570,00		88 123,06	0,69
FR0129513703	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARI ZCP 20/08/2026	20 000 000,000	99,66910	EUR	30/06/2026	19 672 542,34	19 933 820,00		261 277,66	0,47
FR0129513075	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA ZCP 19/11/2026	40 000 000,000	99,00680	EUR	30/06/2026	39 114 108,89	39 602 720,00		488 611,11	0,93
XS3336921476	BANCO SANTANDER SA ZCP 02/10/2026	25 000 000,000	99,36440	EUR	30/06/2026	24 680 084,41	24 841 100,00		161 015,59	0,59
BE6373373859	BELFIUS BANK BELGIUM CDN 10/07/2026	10 000 000,000	99,93880	EUR	30/06/2026	9 943 946,53	9 993 880,00		49 933,47	0,24
FR0129411429	BPIFRANCE SA ZCP 31/08/2026	20 000 000,000	99,59530	EUR	30/06/2026	19 604 767,88	19 919 060,00		314 292,12	0,47
FR0129767267	CA CONSUMER FINANCE ZCP 25/05/2027	20 000 000,000	97,52980	EUR	30/06/2026	19 442 145,44	19 505 960,00		63 814,56	0,46
XS3278651024	CAIXABANK SA ZCP 18/01/2027	8 500 000,000	98,59480	EUR	30/06/2026	8 312 570,02	8 380 558,00		67 987,98	0,20
XS3427420412	CAIXABANK SA ZCP 24/06/2027	6 500 000,000	97,36870	EUR	30/06/2026	6 323 531,32	6 328 965,50		5 434,18	0,15
XS3361234886	CAIXABANK SA ZCP 26/04/2027	7 500 000,000	97,84210	EUR	30/06/2026	7 299 254,29	7 338 157,50		38 903,21	0,17
FR0129780898	CAPGEMINI ZCP 31/07/2026	30 000 000,000	99,78920	EUR	30/06/2026	29 881 470,17	29 936 760,00		55 289,83	0,71
XS3384714914	CARLSBERG BREWERIES ZCP 19/08/2026	20 000 000,000	99,66650	EUR	30/06/2026	19 881 358,00	19 933 300,00		51 942,00	0,47
XS3395915559	CARLSBERG BREWERIES ZCP 24/08/2026	27 000 000,000	99,63330	EUR	30/06/2026	26 847 090,90	26 900 991,00		53 900,10	0,63
FR0129678647	CIE GLE DES ETABLISS MICHELIN ZCP 06/07/2026	20 000 000,000	99,96120	EUR	30/06/2026	19 961 239,16	19 992 240,00		31 000,84	0,47
XS3367683490	COCA COLA EUROPEAN ZCP 03/07/2026	11 000 000,000	99,98010	EUR	30/06/2026	10 959 450,03	10 997 811,00		38 360,97	0,26
XS3425735506	COCA COLA EUROPEAN ZCP 08/07/2026	15 000 000,000	99,94700	EUR	30/06/2026	14 986 216,84	14 992 050,00		5 833,16	0,35
XS3325957507	COCA COLA HBC FINANCE ZCP 19/03/2027	10 000 000,000	98,05280	EUR	30/06/2026	9 744 325,15	9 805 280,00		60 954,85	0,23
FR0129810091	COFACE SA ZCP 03/09/2026	30 000 000,000	99,55400	EUR	30/06/2026	29 868 037,20	29 866 200,00		-1 837,20	0,70
FR0129713873	COFACE SA ZCP 31/07/2026	20 000 000,000	99,79060	EUR	30/06/2026	19 937 584,28	19 958 120,00		20 535,72	0,47
BE6374744017	COFINIMMO SA ZCP 04/08/2026	10 000 000,000	99,76440	EUR	30/06/2026	9 960 674,70	9 976 440,00		15 765,30	0,24
BE6374858189	COFINIMMO SA ZCP 13/07/2026	10 000 000,000	99,91260	EUR	30/06/2026	9 979 290,20	9 991 260,00		11 969,80	0,24
BE6375143128	COFINIMMO SA ZCP 22/07/2026	28 000 000,000	99,85210	EUR	30/06/2026	27 943 879,38	27 958 588,00		14 708,62	0,66

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
DE000CZ459C2	COMMERZBANK AG ZCP 03/02/2027	10 000 000,000	98,46080	EUR	30/06/2026	9 775 144,52	9 846 080,00		70 935,48	0,23
DE000CZ46AH6	COMMERZBANK AG ZCP 12/03/2027	20 000 000,000	98,16070	EUR	30/06/2026	19 504 985,15	19 632 140,00		127 154,85	0,46
DE000CZ458N1	COMMERZBANK AG ZCP 13/11/2026	20 000 000,000	99,08560	EUR	30/06/2026	19 629 493,31	19 817 120,00		187 626,69	0,47
DE000CZ456M7	COMMERZBANK AG ZCP 14/09/2026	20 000 000,000	99,50320	EUR	30/06/2026	19 574 472,71	19 900 640,00		326 167,29	0,47
DE000CZ46BP7	COMMERZBANK AG ZCP 15/06/2027	20 000 000,000	97,38540	EUR	30/06/2026	19 433 124,95	19 477 080,00		43 955,05	0,46
DE000CZ46AL8	COMMERZBANK AG ZCP 17/12/2026	15 000 000,000	98,83360	EUR	30/06/2026	14 722 772,24	14 825 040,00		102 267,76	0,35
DE000CZ458Q4	COMMERZBANK AG ZCP 18/01/2027	20 000 000,000	98,58790	EUR	30/06/2026	19 551 255,24	19 717 580,00		166 324,76	0,46
DE000CZ46AQ7	COMMERZBANK AG ZCP 20/04/2027	20 000 000,000	97,84240	EUR	30/06/2026	19 464 678,10	19 568 480,00		103 801,90	0,46
FR0129783991	COVIVIO SA ZCP 17/07/2026	10 000 000,000	99,88890	EUR	30/06/2026	9 981 600,58	9 988 890,00		7 289,42	0,24
FR0129783751	COVIVIO ZCP 15/09/2026	20 000 000,000	99,48130	EUR	30/06/2026	19 875 556,93	19 896 260,00		20 703,07	0,47
XS3429165031	DANAHER CORPORATION ZCP 21/12/2026	15 000 000,000	98,70620	EUR	30/06/2026	14 803 832,77	14 805 930,00		2 097,23	0,35
FR0129783884	DASSAULT SYSTEMES ZCP 16/09/2026	20 000 000,000	99,47010	EUR	30/06/2026	19 876 818,94	19 894 020,00		17 201,06	0,47
FR0129711869	DASSULT SYSTEMS ZCP 29/07/2026	20 000 000,000	99,80780	EUR	30/06/2026	19 960 494,80	19 961 560,00		1 065,20	0,47
FR0129781599	ELECTRICITE DE FRANCE ZCP 01/07/2026	40 000 000,000	99,99350	EUR	30/06/2026	39 925 804,55	39 997 400,00		71 595,45	0,94
FR0129787299	ELECTRICITE DE FRANCE ZCP 04/09/2026	40 000 000,000	99,55470	EUR	30/06/2026	39 754 801,22	39 821 880,00		67 078,78	0,94
FR0129809010	ELECTRICITE DE ZCP 03/07/2026	50 000 000,000	99,98040	EUR	30/06/2026	49 977 308,91	49 990 200,00		12 891,09	1,18
FR0129806107	ELIS SA ZCP 15/07/2026	25 000 000,000	99,89810	EUR	30/06/2026	24 948 439,89	24 974 525,00		26 085,11	0,59
ES05306748E7	ENDESA SA ZCP 24/08/2026	20 000 000,000	99,61870	EUR	30/06/2026	19 914 428,81	19 923 740,00		9 311,19	0,47
ES05306747Z4	ENDESA ZCP 10/07/2026	25 000 000,000	99,93650	EUR	30/06/2026	24 919 158,10	24 984 125,00		64 966,90	0,59
XS3430530702	ENEL FINANCE INTERN ZCP 17/07/2026	26 000 000,000	99,88510	EUR	30/06/2026	25 970 444,19	25 970 126,00		-318,19	0,61
XS3420336953	ENEL FINANCE INTERNATIONAL ZCP 20/07/2026	20 000 000,000	99,86470	EUR	30/06/2026	19 959 094,94	19 972 940,00		13 845,06	0,47
FR0129807485	ENGIE ZCP 18/09/2026	25 000 000,000	99,45410	EUR	30/06/2026	24 845 502,39	24 863 525,00		18 022,61	0,59
FR0129715100	ESSILORLUXOTTICA SA ZCP 27/07/2026	50 000 000,000	99,82330	EUR	30/06/2026	49 792 325,73	49 911 650,00		119 324,27	1,18
XS3420471735	FIDELITY NATIONAL INFORMATION SE ZCP 22/07/2026	21 000 000,000	99,85240	EUR	30/06/2026	20 957 212,36	20 969 004,00		11 791,64	0,49
XS3367620492	HEINEKEN NV ZCP 06/07/2026	10 000 000,000	99,96080	EUR	30/06/2026	9 961 300,35	9 996 080,00		34 779,65	0,24
XS3367672709	IBERDROLA INTERNATIONAL BV ZCP 03/07/2026	10 000 000,000	99,98030	EUR	30/06/2026	9 963 053,68	9 998 030,00		34 976,32	0,24
XS3413324784	IBERDROLA INTERNATIONAL BV ZCP 15/07/2026	30 000 000,000	99,90160	EUR	30/06/2026	29 941 364,83	29 970 480,00		29 115,17	0,71
XS3375218867	IBERDROLA INTERNATIONAL BVZCP 08/07/2026	20 000 000,000	99,94760	EUR	30/06/2026	19 925 889,53	19 989 520,00		63 630,47	0,47
XS3297678768	INTESA SANPAOLO BAN ZCP 10/02/2027	10 000 000,000	98,38360	EUR	30/06/2026	9 779 010,66	9 838 360,00		59 349,34	0,23
XS3415149593	INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOUR ZCP 15/06/2027	20 000 000,000	97,39240	EUR	30/06/2026	19 439 810,00	19 478 480,00		38 670,00	0,46
XS3396973888	INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA ZCP 28/05/2027	20 000 000,000	97,53720	EUR	30/06/2026	19 461 805,40	19 507 440,00		45 634,60	0,46

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
XS3397034185	INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA ZCP 30/03/2027	20 000 000,000	98,00770	EUR	30/06/2026	19 558 401,18	19 601 540,00		43 138,82	0,46
XS3371668735	INTESA SANPAOLO BANK ZCP 05/05/2027	10 000 000,000	97,72150	EUR	30/06/2026	9 720 860,10	9 772 150,00		51 289,90	0,23
XS3273012412	INTESA SANPAOLO BANK ZCP 08/01/2027	20 000 000,000	98,63840	EUR	30/06/2026	19 557 054,45	19 727 680,00		170 625,55	0,46
XS3154041423	INTESA SANPAOLO BANK ZCP 13/08/2026	12 500 000,000	99,71610	EUR	30/06/2026	12 231 322,02	12 464 512,50		233 190,48	0,29
XS3155652863	INTESA SANPAOLO BANK ZCP 17/08/2026	30 000 000,000	99,68980	EUR	30/06/2026	29 355 898,96	29 906 940,00		551 041,04	0,70
FR0129680205	ITM ENTREPRISES SA ZCP 22/07/2026	20 000 000,000	99,85270	EUR	30/06/2026	19 958 834,90	19 970 540,00		11 705,10	0,47
BE6375183520	KBC GROUP NV CDN 23/12/2026	8 000 000,000	98,70120	EUR	30/06/2026	7 894 996,55	7 896 096,00		1 099,45	0,19
BE6375076427	KBC GROUP NV ZCP 18/09/2026	15 000 000,000	99,44360	EUR	30/06/2026	14 903 261,28	14 916 540,00		13 278,72	0,35
XS3411930442	KEINEKEN NV ZCP 17/07/2026	20 000 000,000	99,88880	EUR	30/06/2026	19 954 796,84	19 977 760,00		22 963,16	0,47
FR0129632651	KERING FINANCE SNC ZCP 07/08/2026	25 000 000,000	99,74250	EUR	30/06/2026	24 863 303,63	24 935 625,00		72 321,37	0,59
FR0129756021	KLEPIERRE ZCP 21/07/2026	15 000 000,000	99,85800	EUR	30/06/2026	14 943 155,85	14 978 700,00		35 544,15	0,35
XS3355988224	LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC ZCP 20/04/2027	15 000 000,000	97,82840	EUR	30/06/2026	14 601 382,26	14 674 260,00		72 877,74	0,35
XS3418600089	LLOYDS BANK CORPORATE ZCP 17/06/2027	5 000 000,000	97,35820	EUR	30/06/2026	4 864 254,86	4 867 910,00		3 655,14	0,11
FR0129621878	LOC D EQUIPEMENTS ZCP 12/02/2027	15 000 000,000	98,28700	EUR	30/06/2026	14 657 646,24	14 743 050,00		85 403,76	0,35
XS3415281438	LSEG NETHERLANDS BV ZCP 15/09/2026	30 000 000,000	99,49120	EUR	30/06/2026	29 811 821,16	29 847 360,00		35 538,84	0,70
XS3415286742	LSEG NETHERLANDS BV ZCP 16/12/2026	10 000 000,000	98,83250	EUR	30/06/2026	9 862 386,83	9 883 250,00		20 863,17	0,23
FR0129439685	MEDIOBANCA INTERNATIONAL (LUXE ZCP 14/10/2026	10 000 000,000	99,29000	EUR	30/06/2026	9 786 267,90	9 929 000,00		142 732,10	0,23
XS3408779000	NATWEST MARKETS NV ZCP 09/06/2027	15 000 000,000	97,46160	EUR	30/06/2026	14 575 559,70	14 619 240,00		43 680,30	0,34
XS3274467201	NATWEST MARKETS NV ZCP 12/01/2027	15 000 000,000	98,65340	EUR	30/06/2026	14 666 340,75	14 798 010,00		131 669,25	0,35
XS3427507374	NATWEST MARKETS NV ZCP 24/06/2027	15 000 000,000	97,33290	EUR	30/06/2026	14 589 176,88	14 599 935,00		10 758,12	0,34
XS3415149833	NTT FINANCE UK LIMITED ZCP 04/09/2026	30 500 000,000	99,55050	EUR	30/06/2026	30 333 586,57	30 362 902,50		29 315,93	0,72
XS3386608122	NTT FINANCE UK LIMITED ZCP 13/07/2026	30 000 000,000	99,90880	EUR	30/06/2026	29 898 196,64	29 972 640,00		74 443,36	0,71
XS3396982285	NTT FINANCE UK LTD ZCP 06/08/2026	20 000 000,000	99,74630	EUR	30/06/2026	19 908 421,26	19 949 260,00		40 838,74	0,47
XS3417520197	NTT FINANCE UK LTD ZCP 17/09/2026	24 000 000,000	99,45930	EUR	30/06/2026	23 846 889,72	23 870 232,00		23 342,28	0,56
XS3415315608	NTT FINANCE UK LTD ZCP 17/09/2026	33 500 000,000	99,45930	EUR	30/06/2026	33 284 795,31	33 318 865,50		34 070,19	0,78
XS3219260372	OP CORPORATE BANK P ZCP 23/10/2026	30 000 000,000	99,21980	EUR	30/06/2026	29 370 428,55	29 765 940,00		395 511,45	0,70
XS3351072502	OP CORPORATE BANK PLC ZCP 16/11/2026	20 000 000,000	99,04190	EUR	30/06/2026	19 699 053,19	19 808 380,00		109 326,81	0,47
XS3418592716	OPEN BANK SOCIEDAD ANONIMA ZCP 17/06/2027	20 000 000,000	97,38100	EUR	30/06/2026	19 443 631,29	19 476 200,00		32 568,71	0,46
FR0129783272	PR FIANANCE ZCP 27/07/2026	7 000 000,000	99,81740	EUR	30/06/2026	6 976 319,27	6 987 218,00		10 898,73	0,16
FR0129630416	RTE RESEAU DE TRANSP ELECTRI ZCP 08/07/2026	20 000 000,000	99,94670	EUR	30/06/2026	19 885 393,85	19 989 340,00		103 946,15	0,47

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
XS3298732184	SANTANDER CONSUMER FIN ZCP 11/02/2027	20 000 000,000	98,37010	EUR	30/06/2026	19 560 922,49	19 674 020,00		113 097,51	0,46
XS3299470412	SANTANDER CONSUMER ZCP 11/12/2026	15 000 000,000	98,85530	EUR	30/06/2026	14 730 276,37	14 828 295,00		98 018,63	0,35
FR0129788875	SAVENCIA SA ZCP 08/07/2026	10 000 000,000	99,94570	EUR	30/06/2026	9 980 288,90	9 994 570,00		14 281,10	0,24
FR0129805828	SAVENCIA SA ZCP 15/07/2026	30 000 000,000	99,89810	EUR	30/06/2026	29 938 874,80	29 969 430,00		30 555,20	0,71
FR0129809820	SAVENCIA SA ZCP 28/08/2026	30 000 000,000	99,59570	EUR	30/06/2026	29 877 584,90	29 878 710,00		1 125,10	0,70
FR0129780146	SCHNEIDER ELECTRIC SE ZCP 28/08/2026	30 000 000,000	99,60780	EUR	30/06/2026	29 820 908,87	29 882 340,00		61 431,13	0,70
FR0129683191	SEB SA ZCP 16/07/2026	10 000 000,000	99,89330	EUR	30/06/2026	9 942 197,20	9 989 330,00		47 132,80	0,24
FR0129782910	SONEPAR SA ZCP 03/08/2026	10 000 000,000	99,76740	EUR	30/06/2026	9 960 338,50	9 976 740,00		16 401,50	0,24
FR0129782928	SONEPAR ZCP 03/07/2026	10 000 000,000	99,98000	EUR	30/06/2026	9 981 119,00	9 998 000,00		16 881,00	0,24
BE6372829265	SUMITOMO MITSUI BANKING ZCP 07/08/2026	50 000 000,000	99,75580	EUR	30/06/2026	49 709 736,56	49 877 900,00		168 163,44	1,18
XS3288981957	SVENSKA HANDELSBANKEN AB ZCP 29/01/2027	15 000 000,000	98,49870	EUR	30/06/2026	14 672 142,82	14 774 805,00		102 662,18	0,35
FR0129784411	TELEPERFORMANCE SE ZCP 24/07/2026	15 000 000,000	99,83670	EUR	30/06/2026	14 970 574,50	14 975 505,00		4 930,50	0,35
FR0129487114	UNEDIC SA ZCP 06/11/2026	10 000 000,000	99,12000	EUR	30/06/2026	9 783 847,63	9 912 000,00		128 152,37	0,23
FR0129629715	UNIVERSAL MUSIC GROUP N V ZCP 22/07/2026	63 000 000,000	99,85110	EUR	30/06/2026	62 673 025,41	62 906 193,00		233 167,59	1,48
FR0129629590	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV ZCP 31/07/2026	12 500 000,000	99,78650	EUR	30/06/2026	12 450 612,57	12 473 312,50		22 699,93	0,29
FR0129672830	VEOLIA ENVIRONNEMENT ZCP 17/03/2027	15 000 000,000	98,09260	EUR	30/06/2026	14 619 071,66	14 713 890,00		94 818,34	0,35
FR0129782480	VINCI ZCP 02/07/2026	30 000 000,000	99,98690	EUR	30/06/2026	29 943 606,21	29 996 070,00		52 463,79	0,71
FR0129683035	VINCI ZCP 13/07/2026	15 000 000,000	99,91470	EUR	30/06/2026	14 914 640,61	14 987 205,00		72 564,39	0,35
FR0129682839	VIVENDI SE ZCP 15/07/2026	10 000 000,000	99,89640	EUR	30/06/2026	9 979 624,93	9 989 640,00		10 015,07	0,24

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
Total Interets precomptes.						2 216 938 853,20	2 225 296 623,50		8 357 770,30	52,43
Total Creances negociables						3 160 938 853,20	3 175 808 900,89	6 411 033,39	8 459 014,30	74,82
Swap de Taux										
SWAP04780106	2862709242	12 500 000,000	100,04735	EUR	30/06/2026		19 085,87	13 166,67	5 919,20	
SWAP04780461	2863881832	30 000 000,000	100,05271	EUR	30/06/2026		49 124,06	33 311,67	15 812,39	
SWAP04806155	2892744252	20 000 000,000	100,08151	EUR	30/06/2026		32 701,70	16 400,00	16 301,70	
SWAP04817097	2905161052	20 000 000,000	100,05870	EUR	30/06/2026		22 411,73	10 670,77	11 740,96	
SWAP04827610	2923119492	7 800 000,000	100,09342	EUR	30/06/2026		11 669,53	4 382,74	7 286,79	
SWAP04839652	2926627552	10 000 000,000	100,12655	EUR	30/06/2026		20 954,47	8 299,00	12 655,47	
SWAP04865041	2935657812	30 000 000,000	100,14264	EUR	30/06/2026		68 398,67	25 605,50	42 793,17	
SWAP04879695	2949187952	10 000 000,000	100,14912	EUR	30/06/2026		20 042,51	5 130,84	14 911,67	
SWAP04884340	2957753962	8 800 000,000	100,01083	EUR	30/06/2026		3 466,89	2 513,50	953,39	
SWAP04892722	2962625832	40 000 000,000	100,16052	EUR	30/06/2026		77 869,15	13 662,80	64 206,35	
SWAP04892725	2962647772	20 000 000,000	100,04385	EUR	30/06/2026		14 911,43	6 142,00	8 769,43	
SWAP04922655	3009856922	9 500 000,000	100,21776	EUR	30/06/2026		21 908,67	1 221,92	20 686,75	
SWAP04922656	3009858932	15 000 000,000	100,05421	EUR	30/06/2026		10 347,33	2 216,01	8 131,32	
SWAP04923392	3013661662	20 000 000,000	100,21847	EUR	30/06/2026		46 398,61	2 703,70	43 694,91	
SWAP04923752	3015607942	15 000 000,000	100,22380	EUR	30/06/2026		35 494,97	1 924,57	33 570,40	
SWAP04924848	3017270942	20 000 000,000	100,13739	EUR	30/06/2026		29 886,67	2 408,95	27 477,72	
SWAP04943108	3021967322	8 500 000,000	100,23289	EUR	30/06/2026		20 881,36	1 085,40	19 795,96	
SWAP04943109	3022014132	20 000 000,000	100,23344	EUR	30/06/2026		49 332,18	2 643,33	46 688,85	
SWAP04947612	3032560652	12 000 000,000	100,26175	EUR	30/06/2026		32 191,28	781,23	31 410,05	
SWAP04947611	3033105672	4 000 000,000	100,22132	EUR	30/06/2026		9 193,69	340,81	8 852,88	
SWAP04976196	3037280862	15 000 000,000	100,25993	EUR	30/06/2026		41 973,87	2 983,64	38 990,23	
SWAP04986425	3042209452	10 000 000,000	100,26411	EUR	30/06/2026		28 112,72	1 702,19	26 410,53	
SWAP04987017	3047030172	3 124 000,000	100,25543	EUR	30/06/2026		8 493,15	513,43	7 979,72	
SWAP04987122	3050153122	10 000 000,000	100,27536	EUR	30/06/2026		29 222,65	1 686,36	27 536,29	
SWAP04987234	3051781772	20 000 000,000	100,27658	EUR	30/06/2026		58 634,40	3 319,00	55 315,40	
SWAP04987354	3053286692	15 000 000,000	100,18279	EUR	30/06/2026		30 094,73	2 675,66	27 419,07	
SWAP04987353	3053302732	15 000 000,000	100,28208	EUR	30/06/2026		45 157,11	2 845,66	42 311,45	
SWAP05010383	3089978672	20 000 000,000	100,14777	EUR	30/06/2026		17 480,83	-12 072,66	29 553,49	
SWAP05011031	3094522902	15 000 000,000	100,07398	EUR	30/06/2026		2 610,92	-8 485,90	11 096,82	
SWAP05011029	3094554102	15 000 000,000	100,11230	EUR	30/06/2026		5 976,18	-10 869,23	16 845,41	
SWAP05011030	3095024362	15 000 000,000	100,12453	EUR	30/06/2026		8 308,14	-10 370,90	18 679,04	
SWAP05011167	3099338312	10 000 000,000	100,00949	EUR	30/06/2026		-237,70	-1 187,05	949,35	
SWAP05011283	3101407942	10 000 000,000	100,13411	EUR	30/06/2026		7 037,11	-6 373,84	13 410,95	
SWAP05016334	3119675662	25 000 000,000	100,00085	EUR	30/06/2026		-16 132,17	-16 344,17	212,00	
SWAP05016335	3119812902	30 000 000,000	100,00039	EUR	30/06/2026		-5 598,90	-5 716,34	117,44	
SWAP05017475	3121777262	10 000 000,000	99,98169	EUR	30/06/2026		-11 978,84	-10 147,77	-1 831,07	
SWAP05018315	3123552652	20 000 000,000	100,00283	EUR	30/06/2026		-4 434,29	-4 999,98	565,69	
SWAP05019255	3126897932	10 000 000,000	100,00493	EUR	30/06/2026		-849,75	-1 343,22	493,47	
SWAP05019524	3132138012	15 000 000,000	100,00396	EUR	30/06/2026		-3 085,65	-3 680,24	594,59	
SWAP05019593	3134415152	20 000 000,000	100,00581	EUR	30/06/2026		-11 121,29	-12 283,73	1 162,44	
SWAP05020023	3138830172	20 000 000,000	100,03367	EUR	30/06/2026		-7 532,29	-14 266,70	6 734,41	
SWAP05020022	3138877082	15 000 000,000	100,03567	EUR	30/06/2026		-5 277,33	-10 628,16	5 350,83	
SWAP05027220	3145172942	7 500 000,000	99,98650	EUR	30/06/2026		-6 643,39	-5 630,59	-1 012,80	
SWAP05029792	3149823572	10 000 000,000	99,96032	EUR	30/06/2026		-11 623,93	-7 655,61	-3 968,32	
SWAP05029911	3154552562	15 000 000,000	100,01168	EUR	30/06/2026		-421,83	-2 173,12	1 751,29	

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
SWAP05029910	3154561012	10 000 000,000	99,90469	EUR	30/06/2026		-17 347,06	-7 816,25	-9 530,81	
SWAP05030303	3155437292	12 500 000,000	100,00155	EUR	30/06/2026		-4 831,77	-5 025,68	193,91	
SWAP05030302	3155558992	7 400 000,000	100,00038	EUR	30/06/2026		-2 985,35	-3 013,34	27,99	
SWAP05030900	3163652032	15 000 000,000	99,90282	EUR	30/06/2026		-24 171,40	-9 594,60	-14 576,80	
SWAP05034114	3174910502	7 500 000,000	99,99219	EUR	30/06/2026		-3 174,32	-2 588,54	-585,78	
SWAP05034113	3174911342	20 000 000,000	99,96342	EUR	30/06/2026		-15 569,31	-8 254,15	-7 315,16	
SWAP05034115	3174922122	5 000 000,000	99,99286	EUR	30/06/2026		-2 077,67	-1 720,83	-356,84	
SWAP05034112	3174950872	2 214 000,000	100,01257	EUR	30/06/2026		-101,58	-379,92	278,34	
SWAP05034138	3176513182	30 000 000,000	100,01035	EUR	30/06/2026		-98,29	-3 202,46	3 104,17	
SWAP05034191	3180339762	20 000 000,000	100,00205	EUR	30/06/2026		-5 511,44	-5 920,44	409,00	
SWAP05034190	3180341312	20 000 000,000	99,99521	EUR	30/06/2026		-7 481,71	-6 523,22	-958,49	
SWAP05034349	3182094392	30 000 000,000	99,96300	EUR	30/06/2026		-20 537,47	-9 436,98	-11 100,49	
SWAP05034659	3193364822	15 000 000,000	99,87077	EUR	30/06/2026		-22 975,45	-3 591,54	-19 383,91	
SWAP05034885	3200566062	20 000 000,000	99,94345	EUR	30/06/2026		-13 502,56	-2 191,81	-11 310,75	
SWAP05034884	3200962372	20 000 000,000	99,94107	EUR	30/06/2026		-13 996,50	-2 209,87	-11 786,63	
SWAP05035084	3204577712	20 000 000,000	99,97604	EUR	30/06/2026		-6 322,47	-1 530,40	-4 792,07	
SWAP05035083	3204636052	5 000 000,000	99,97652	EUR	30/06/2026		-1 555,92	-381,84	-1 174,08	
SWAP05039959	3212665042	15 000 000,000	99,97243	EUR	30/06/2026		-4 560,20	-425,17	-4 135,03	
SWAP05039958	3212893072	6 500 000,000	99,97975	EUR	30/06/2026		-1 494,79	-178,82	-1 315,97	
SWAP05045726	3219535062	4 100 000,000	100,00149	EUR	30/06/2026		61,16		61,16	
SWAP05030898	ST220726 0.020/OIS+m	35 000 000,000	100,00993	EUR	30/06/2026		-499,53	-3 973,55	3 474,02	

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
Total Swap de Taux							625 701,59	-51 851,27	677 552,86	0,01
Liquidités										
APPELS DE MARGES										
MGBNPEUR	Appel de marge EUR	-625 701,590	1,00000	EUR	30/06/2026	-625 701,59	-625 701,59			-0,01
Total APPELS DE MARGES						-625 701,59	-625 701,59			-0,01
AUTRES										
RMF065EUR	Prov com mvts EUR	-1 934,720	1,00000	EUR	30/06/2026	-1 934,72	-1 934,72			
Total AUTRES						-1 934,72	-1 934,72			
BANQUE OU ATTENTE										
BDS065EUR	Ach diff titres EUR	-14 318 757,300	1,00000	EUR	30/06/2026	-14 318 757,30	-14 318 757,30			-0,34
BK065EUR	Banque EUR SGP	337 510 527,380	1,00000	EUR	30/06/2026	337 510 527,38	338 080 238,12	569 710,74		7,97
BK065USD	Banque USD SGP	87,190	0,87547	USD	30/06/2026	80,50	76,33		-4,17	
Total BANQUE OU ATTENTE						323 191 850,58	323 761 557,15	569 710,74	-4,17	7,63
DEPOSIT DE GARANTIE										
DFPBNPEUR	Deposit OTC Verse	1 275 530,410	1,00000	EUR	30/06/2026	1 275 530,41	1 275 530,41			0,03
Total DEPOSIT DE GARANTIE						1 275 530,41	1 275 530,41			0,03
DEPOTS A TERME										
TD--00234590	DPAT FIX 2.205 01072	150 000 000,000	1,00000	EUR	30/06/2026	150 000 000,00	150 009 187,50	9 187,50		3,53
Total DEPOTS A TERME						150 000 000,00	150 009 187,50	9 187,50		3,53
FRAIS DE GESTION										
F110EUR	PrComGestFin	-263 131,390	1,00000	EUR	30/06/2026	-263 131,39	-263 131,39			-0,01
F170EURCP	PrComVariable	-15 916,840	1,00000	EUR	30/06/2026	-15 916,84	-15 916,84			
F171EURCP	PrComVariableAcqu	-17 756,380	1,00000	EUR	30/06/2026	-17 756,38	-17 756,38			
F110EUR-	PrN-1ComGestFin	-1 931,980	1,00000	EUR	30/06/2026	-1 931,98	-1 931,98			
Total FRAIS DE GESTION						-298 736,59	-298 736,59			-0,01
Total Liquidités						473 541 008,09	474 119 902,16	578 898,24	-4,17	11,17

▼ Cours des devises utilisées

Devise	Date du cours	Cours utilisé	Cours inverse
EUR/USD	29/06/2026	1,14225000	0,87546509