



KPMG S.A.
Tour EQHO
2 avenue Gambetta
CS 60055
92066 Paris La Défense Cedex
France

Fonds Commun de Placement AFER OBLIG MONDE ENTREPRISES

**Attestation du commissaire aux comptes sur la composition de l'actif
au 30 juin 2026**

Fonds Commun de Placement
AFER OBLIG MONDE ENTREPRISES
127-129, quai du Président Roosevelt - 92130 Issy-les-Moulineaux

KPMG S.A., société d'expertise comptable et de commissaires aux comptes inscrite au Tableau de l'Ordre des experts comptables de Paris sous le n° 14-30080101 et rattachée à la Compagnie régionale des commissaires aux comptes de Versailles et du Centre.
Société française membre du réseau KPMG constitué de cabinets indépendants affiliés à KPMG International Limited, une société de droit anglais (« private company limited by guarantee »).

Société anonyme à conseil d'administration
Siège social :
Tour EQHO
2 avenue Gambetta
CS 60055
92066 Paris La Défense Cedex
Capital social : 5 497 100 €
775 726 417 RCS Nanterre



KPMG S.A.
Tour EQHO
2 avenue Gambetta
CS 60055
92066 Paris La Défense Cedex
France

**Fonds Commun de Placement
AFER OBLIG MONDE ENTREPRISES**

127-129, quai du Président Roosevelt - 92130 Issy-les-Moulineaux

**Attestation du commissaire aux comptes sur la composition de l'actif
au 30 juin 2026**

En notre qualité de commissaire aux comptes du fonds et en application des dispositions du règlement général de l'Autorité des marchés financiers 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 du fonds. 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 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 mission. 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 acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Paris La Défense

KPMG S.A.

Séverine Ernest
Associée

Inventaire du portefeuille AFER OBLIG MONDE ENTREPRISES

au 30/06/2026

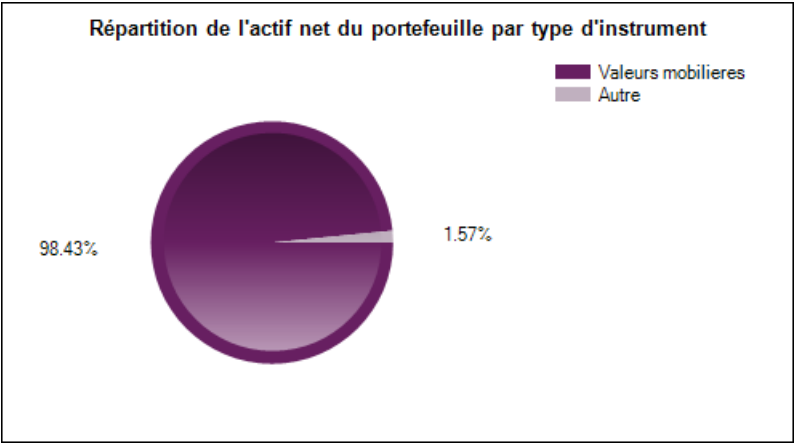
▼ Descriptif du portefeuille

Libellé	Code	Actif net	Dev	Statut VL
AFER OBLIG MONDE ENTREPRISES	FAMA54	480 805 962.54 EUR		OFF

▼ Synthèse

Part	Code ISIN	VL	Actif de la part	Dev	Nombre de parts
AG	FR001400RXY5	105.20	15 549 160.07000	EUR	147 798.00
D	FR0011731710	103.32	464 559 518.68000	EUR	4 495 935.9998
DD	FR001400LOS2	100.70	697 283.79000	EUR	6 924.00

Valeur boursière	Prix de revient	+/- value	Intérêts courus
Valeurs mobilières			
481 057 192.96	458 583 333.94	19 668 673.41	2 805 185.61
Futures			
702 798.48		702 798.48	
Change a terme			
-5 827 781.25		-5 827 781.25	
Derives de credit			
-2 100 373.80		-2 074 123.80	-26 250.00
Liquidités			
6 974 126.15	6 971 748.72	2 377.43	
Total			
480 805 962.54	465 555 082.66	12 471 944.27	2 778 935.61



v Détails

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
Valeurs mobilières										
Obligation										
US00287YCA55	ABBVIE INC 4.05% 21/11/2039	5 500 000.000	88.11400	USD	30/06/2026	4 417 404.87	4 260 491.56	21 647.86	-178 561.17	0.89
US01626PAH91	ALIMENTATION COUCHE TARD 3.55% 26/07/2027	2 984 000.000	99.16900	USD	30/06/2026	2 655 931.52	2 628 192.57	39 892.95	-67 631.90	0.55
US02079KBA43	ALPHABET INC 5.45% 15/11/2055	4 500 000.000	95.89300	USD	30/06/2026	3 925 526.11	3 801 734.02	27 409.69	-151 201.78	0.79
US025816DV84	AMERICAN EXPRESS CO VAR 26/07/2028	5 130 000.000	100.59800	USD	30/06/2026	4 695 128.62	4 611 269.71	97 426.10	-181 285.01	0.96
US03027XAX84	AMERICAN TOWER CORP 2.75% 15/01/2027	3 412 000.000	99.10800	USD	30/06/2026	2 989 315.92	2 995 566.36	37 843.14	-31 592.70	0.62
US031162DR88	AMGEN INC 5.25% 02/03/2033	2 380 000.000	101.79400	USD	30/06/2026	2 233 699.35	2 155 164.98	36 126.06	-114 660.43	0.45
US03522AAJ97	ANHEUSER BUSCH CO NBEV 4.9% 01/02/2046	4 500 000.000	91.19500	USD	30/06/2026	3 825 938.62	3 669 771.71	80 359.49	-236 526.40	0.76
US037833EW60	APPLE INC 4.85% 10/05/2053	4 766 000.000	91.79500	USD	30/06/2026	4 313 516.57	3 855 240.17	28 641.99	-486 918.39	0.80
US04636NAL73	ASTRAZENECA FINANCE LLC 4.8% 26/02/2029	4 030 000.000	101.02500	USD	30/06/2026	3 752 338.97	3 620 374.20	59 360.03	-191 324.80	0.75
US00206RMT67	AT&T INC 5.40% 15/02/2034	3 000 000.000	101.40900	USD	30/06/2026	2 791 413.07	2 714 484.39	53 529.26	-130 457.94	0.56
US05964HBD61	BANCO SANTANDER SA 6.35% 14/03/2034	4 400 000.000	105.79100	USD	30/06/2026	4 203 164.01	4 144 011.10	72 635.26	-131 788.17	0.86
US06406RBV87	BANK OF NY MELLON CORP VAR 14/03/2030	2 000 000.000	100.89300	USD	30/06/2026	1 859 638.98	1 790 810.47	25 866.89	-94 695.40	0.37
US06738ECV56	BARCLAYS PLC VAR 10/09/2035	4 600 000.000	99.34600	USD	30/06/2026	4 145 325.75	4 063 311.54	66 183.92	-148 198.13	0.85
US09659W2P81	BNP PARIBAS VAR 19/04/2032	4 900 000.000	90.89700	USD	30/06/2026	3 935 767.87	3 920 308.58	24 609.29	-40 068.58	0.82
US101137AL15	BOSTON SCIENTIFIC 7.375% 15/01/2040	2 500 000.000	118.74700	USD	30/06/2026	2 604 283.48	2 670 945.82	74 361.37	-7 699.03	0.56
US05571AAY10	BPCE SA VAR 30/05/2035	5 100 000.000	102.56500	USD	30/06/2026	4 714 054.38	4 597 991.72	22 801.48	-138 864.14	0.96
US14739LAB80	CASCADES INC USA INC 5.375% 15/01/2028	290 000.000	99.85200	USD	30/06/2026	246 015.75	259 562.99	6 286.69	7 260.55	0.05
US149123CH22	CATERPILLAR INC 2.6% 09/04/2030	3 700 000.000	93.74800	USD	30/06/2026	3 101 023.04	3 053 081.62	19 165.77	-67 107.19	0.63
US17275RBR21	CISCO SYSTEMS INC 4.85% 26/02/2029	4 122 000.000	101.07200	USD	30/06/2026	3 843 455.61	3 704 717.46	60 715.15	-199 453.30	0.77
US172967EW71	CITIGROUP 8.125% 15/07/39	4 000 000.000	125.08400	USD	30/06/2026	4 602 048.96	4 507 321.88	131 077.68	-225 804.76	0.94
US191216DJ60	COCA COLA CO 1.5% 05/03/2028	4 534 000.000	95.73800	USD	30/06/2026	3 819 129.81	3 815 862.20	19 167.61	-22 435.22	0.79
US20030NEJ63	COMCAST CORP 5.30% 01/06/2034	4 644 000.000	100.42200	USD	30/06/2026	4 313 249.65	4 097 007.50	17 940.17	-234 182.32	0.85
US126650EB25	CVS HEALTH CORP 5.40% 01/06/2029	2 338 000.000	102.22500	USD	30/06/2026	2 194 346.02	2 099 660.19	9 202.31	-103 888.14	0.44
US244199BJ37	DEERE AND COMPANY 3.1% 15/04/2030	4 670 000.000	95.11600	USD	30/06/2026	3 988 679.80	3 911 903.93	26 731.88	-103 507.75	0.81
US251526CX52	DEUTSCHE BANK NY VAR 11/09/2030	5 450 000.000	100.38700	USD	30/06/2026	4 901 087.50	4 858 825.79	73 475.05	-115 736.76	1.01
US25156PAD50	DEUTSCHE TELEKOM 9.25% 01/06/2032	1 500 000.000	121.82000	USD	30/06/2026	1 742 362.62	1 608 381.44	10 113.27	-144 094.45	0.33
US532457CR72	ELI LILLY & CO 4.6% 14/08/2034	5 500 000.000	98.64700	USD	30/06/2026	4 890 005.96	4 829 760.83	84 212.86	-144 457.99	1.00
US31428XCD66	FEDEX CORP 2.4% 15/05/2031	1 000 000.000	89.91300	USD	30/06/2026	800 388.53	789 116.30	2 682.30	-13 954.53	0.16
US30251GBA40	FMG RESOURCES AUG 2006 4.5% 15/09/2027	195 000.000	99.20600	USD	30/06/2026	164 868.82	171 464.58	2 259.91	4 335.85	0.04
US345397G230	FORD MOTORS CREDIT CO LLC 5.303% 06/09/2029	2 400 000.000	99.66900	USD	30/06/2026	2 183 200.74	2 127 798.77	35 560.51	-90 962.48	0.44

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
US37045XDE31	GENERAL MOTORS FINL CO 2.35% 08/01/2031	6 438 000.000	89.48900	USD	30/06/2026	4 995 390.92	5 102 778.37	63 591.96	43 795.49	1.06
US38141GGM06	GSACHS G 6.25% 01/02/41 *USD	4 000 000.000	106.45200	USD	30/06/2026	3 883 058.66	3 815 487.33	91 110.53	-158 681.86	0.79
US437076DD13	HOME DEPOT INC 4.85% 25/06/2031	4 408 000.000	101.26900	USD	30/06/2026	4 074 929.38	3 907 548.89	3 116.53	-170 497.02	0.81
US404280DW61	HSBC HOLDINGS PLC VAR 09/03/2044	4 400 000.000	107.02700	USD	30/06/2026	4 358 382.72	4 194 757.32	75 813.91	-239 439.31	0.87
US459200KB68	IBM CORP 4.15% 15/05/2039	5 500 000.000	87.11400	USD	30/06/2026	4 428 334.42	4 216 247.07	25 509.73	-237 597.08	0.88
US449691AC82	ILIAD HOLDING SAS 7% 15/10/2028	400 000.000	100.59200	USD	30/06/2026	350 284.04	357 105.84	5 170.22	1 651.58	0.07
US458140CN85	INTEL CORP 5.0% 21/02/2021	2 418 000.000	100.83900	USD	30/06/2026	2 225 477.09	2 170 860.97	38 186.24	-92 802.36	0.45
US46115HBV87	INTESA SANPAOLO SPA 8.248% 21/11/2033	4 900 000.000	115.66400	USD	30/06/2026	5 137 715.63	4 996 450.43	39 277.34	-180 542.54	1.04
US46625HHF01	JPMORGAN CHASE 6.4% 15/05/38	5 485 000.000	109.85000	USD	30/06/2026	5 668 856.09	5 309 304.30	39 233.02	-398 784.81	1.10
US50077LAV80	KRAFT HEINZ FOODS CO 3.75% 01/04/2030	3 436 000.000	96.75900	USD	30/06/2026	2 985 550.62	2 936 107.53	28 175.02	-77 618.11	0.61
US571676BC81	MARS INC 5.7% 01/05/2055	5 000 000.000	98.64300	USD	30/06/2026	4 508 387.39	4 355 505.99	41 546.40	-194 427.80	0.91
US58933YBK01	MERCK CO INC 4.5% 17/05/2033	3 609 000.000	98.90000	USD	30/06/2026	3 229 143.46	3 139 290.21	17 361.58	-107 214.83	0.65
US59217HEC79	MET LIFE GLOB FOUNDING 1 5.05% 08/01/2034	4 800 000.000	100.42700	USD	30/06/2026	4 458 671.60	4 318 186.54	101 886.36	-242 371.42	0.90
US30303M8V78	META PLATFORMS INC 5.40% 15/08/2054	4 734 000.000	88.41400	USD	30/06/2026	4 400 824.50	3 745 379.48	84 469.17	-739 914.19	0.78
US55305BAS07	MI HOMES INC 4.95% 01/02/2028	200 000.000	99.62400	USD	30/06/2026	168 850.06	177 882.45	3 607.98	5 424.41	0.04
US60687YAT64	MIZUHO FINANCIAL GROUP VAR 11/09/2029	4 400 000.000	99.12200	USD	30/06/2026	3 961 546.90	3 864 743.00	50 024.20	-146 828.10	0.80
US61747YEF88	MORGAN STAN VAR 16/09/2036	6 819 000.000	86.81500	USD	30/06/2026	5 149 159.30	5 221 130.51	43 211.46	28 759.75	1.09
US61747YFE05	MORGAN STANLEY VAR 21/04/2034	3 000 000.000	100.69400	USD	30/06/2026	2 702 477.69	2 668 980.15	26 786.50	-60 284.04	0.56
US636274AE20	NATIONAL GRID PLC 5.809% 12/06/2033	3 000 000.000	104.17600	USD	30/06/2026	2 846 016.51	2 741 605.51	8 044.77	-112 455.77	0.57
US632525BN08	NATL AUSTRALIA BANK 4.951% 10/01/2034	3 750 000.000	100.70600	USD	30/06/2026	3 476 954.21	3 380 271.75	77 136.09	-173 818.55	0.70
US68389XCS27	ORACLE CORP 4.2% 27/09/2029	4 474 000.000	97.26100	USD	30/06/2026	4 012 175.62	3 848 965.28	42 915.13	-206 125.47	0.80
US713448FL73	PEPSICO INC 3.6% 18/02/2028	3 000 000.000	98.96600	USD	30/06/2026	2 698 840.74	2 631 750.20	34 898.98	-101 989.52	0.55
US716973AF98	PFIZER INVESTMENT ENTER 5.11% 19/05/2043	5 000 000.000	94.80100	USD	30/06/2026	4 392 307.19	4 172 009.39	26 072.19	-246 369.99	0.87
US771196CM28	ROCHE HOLDINGS INC 5.128% 08/03/2054	3 600 000.000	95.91400	USD	30/06/2026	3 325 254.39	3 071 693.69	51 572.99	-305 133.69	0.64
US78016EYH43	ROYAL BANK OF CANADA 2.3% 03/11/2031	5 462 000.000	89.20200	USD	30/06/2026	4 272 789.44	4 279 238.15	17 702.91	-11 254.20	0.89
US83368TBL17	SOCIETE GENERALE VAR 15/06/2033	2 400 000.000	103.88700	USD	30/06/2026	2 264 347.82	2 186 585.96	5 804.01	-83 565.87	0.45
US86562MCS70	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL CORP INC 5.766% 13/01/2033	3 400 000.000	104.07600	USD	30/06/2026	3 305 076.78	3 175 081.96	80 020.29	-210 015.11	0.66
US87264ADL61	T MOBILE USA INC 4.2% 01/10/2029	2 470 000.000	98.80400	USD	30/06/2026	2 235 795.56	2 157 258.64	22 684.33	-101 221.25	0.45
BE6300372289	TELENET FINANCE LUX NOTE 5.5% 01/03/2028	200 000.000	99.30100	USD	30/06/2026	169 698.74	178 172.64	4 463.20	4 010.70	0.04
US87264ADZ57	T-MOBILE USA INC 5% 15/02/2036	2 400 000.000	97.78700	USD	30/06/2026	2 019 687.18	2 102 004.14	49 272.57	33 044.39	0.44
US89236TLZ65	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 5.10% 21/03/2031	3 524 000.000	101.70600	USD	30/06/2026	3 324 915.19	3 178 555.73	43 665.99	-190 025.45	0.66

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
US902613BL18	UBS GROUP AG VAR 13/09/2030	4 300 000.000	102.37800	USD	30/06/2026	4 055 936.82	3 913 857.52	63 377.33	-205 456.63	0.81
US91324PFG28	UNITEDHEALTH GROUP INC 4.80% 15/01/2030	3 538 000.000	100.78100	USD	30/06/2026	3 303 235.21	3 187 212.03	68 492.72	-184 515.90	0.66
US92343VFR06	VERIZON COMMUNICATIONS 1.75% 20/01/2031	3 000 000.000	87.83300	USD	30/06/2026	2 288 539.95	2 325 259.49	20 536.32	16 183.22	0.48
US931142FE87	WALMART INC 4.5% 15/04/2053	5 242 000.000	86.90200	USD	30/06/2026	4 414 093.74	4 027 990.76	43 557.25	-429 660.23	0.84
US254687FX90	WALT DISNEY COMPANY 2.65% 13/01/2031	5 296 000.000	92.36700	USD	30/06/2026	4 325 554.22	4 335 913.75	57 284.94	-46 925.41	0.90
USU94303AE12	WEA FINANACE LLC 3.5% 15/06/2029	3 500 000.000	96.16600	USD	30/06/2026	2 934 334.65	2 948 705.01	4 762.04	9 608.32	0.61
US95000U2Q52	WELLS FARGO AND COMPANY VAR 30/04/2041	4 639 000.000	76.44700	USD	30/06/2026	3 246 742.12	3 122 970.73	21 093.41	-144 864.80	0.65
US961214EP44	WESTPAC BANKING CORP VAR 15/11/2035	5 438 000.000	90.15100	USD	30/06/2026	4 277 947.82	4 304 163.50	16 215.12	10 000.56	0.90
US98212BAM54	WPX ENERGY INC 5.875% 15/06/2028	109 000.000	100.08510	USD	30/06/2026	93 258.15	95 668.13	248.94	2 161.04	0.02

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
Total Obligation						231 822 853.42	225 196 814.72	2 805 185.61	-9 431 224.31	46.84
Sicav (O.P.C.V.M.)										
LU1184721287	AVIVA INVESTORS SICAV EMERGING MARKETS CORPORATE BOND SICAV	0.001	797.78510	EUR	29/06/2026	0.97	0.80		-0.17	
FR001400KPZ3	OFI INV ESG LIQUIDIT PART I	3.000	1 077.95000	EUR	30/06/2026	3 226.90	3 233.85		6.95	
FR0007030663	OFI INVEST CREDIT EUROPE FCP	57 537.924	683.66000	EUR	29/06/2026	38 836 309.24	39 336 377.05		500 067.81	8.18
FR0010645325	OFI INVEST ESG ALPHA YIELD FCP	42.900	1 731 288.31000	EUR	29/06/2026	61 785 355.28	74 272 268.50		12 486 913.22	15.45
FR0010596783	OFI INVEST ESG EURO HIGH YIELD PART C	533 477.577	135.59000	EUR	30/06/2026	62 017 586.18	72 334 224.71		10 316 638.53	15.04
FR0011869163	OFI INVEST ESG EURO INVESTMENT GRADE CLIMATE FOCUS CH	2 926.000	11 601.27000	EUR	30/06/2026	31 274 320.31	33 945 316.02		2 670 995.71	7.06
FR0011024249	OFI INVEST ISR CREDIT BONDS EURO PART I	20 770.031	1 489.62000	EUR	30/06/2026	27 938 931.51	30 939 453.73		3 000 522.22	6.43
FR001400Z826	OFI INVEST SUB DEBT OPPORTUNITIES PARTS I	4 789.000	1 050.22000	EUR	30/06/2026	4 904 750.13	5 029 503.58		124 753.45	1.05
Total Sicav (O.P.C.V.M.)						226 760 480.52	255 860 378.24		29 099 897.72	53.21
Total Valeurs mobilières						458 583 333.94	481 057 192.96	2 805 185.61	19 668 673.41	100.05
Futures										
Taux (Livraison du sous-jacent)										
DU100926	EURO SCHATZ 0926	146.000	105.96000	EUR	30/06/2026		39 420.00		39 420.00	0.01
G300926	LONG GILT 0926	97.000	89.21000	GBP	30/06/2026		176 793.59		176 793.59	0.04
UXY300926	US 10YR ULT 0926	387.000	112.46875	USD	30/06/2026		486 584.89		486 584.89	0.10
Total Taux (Livraison du sous-jacent)							702 798.48		702 798.48	0.15
Total Futures							702 798.48		702 798.48	0.15
Liquidités										
APPELS DE MARGES										
MGBNPEUR	Appel de marge EUR	2 100 373.800	1.00000	EUR	30/06/2026	2 100 373.80	2 100 373.80			0.44
MGEUR	Appel marge EUR	-39 420.000	1.00000	EUR	30/06/2026	-39 420.00	-39 420.00			-0.01
MGGBP	Appel marge GBP	-152 290.000	1.16090	GBP	30/06/2026	-176 440.62	-176 793.59		-352.97	-0.04
MGUSD	Appel marge USD	-556 312.500	0.87466	USD	30/06/2026	-486 956.23	-486 584.89		371.34	-0.10
Total APPELS DE MARGES						1 397 556.95	1 397 575.32		18.37	0.29
AUTRES										
RMF065EUR	Prov com mvts EUR	-726.920	1.00000	EUR	30/06/2026	-726.92	-726.92			
Total AUTRES						-726.92	-726.92			
BANQUE OU ATTENTE										
BK065EUR	Banque EUR SGP	-2 153 292.260	1.00000	EUR	30/06/2026	-2 153 292.26	-2 153 292.26			-0.45
BK065GBP	Banque GBP SGP	116 167.620	1.16090	GBP	30/06/2026	134 617.32	134 859.09		241.77	0.03
BK065USD	Banque USD SGP	-29 001.960	0.87466	USD	30/06/2026	-25 366.89	-25 366.89			-0.01
Total BANQUE OU ATTENTE						-2 044 041.83	-2 043 800.06		241.77	-0.43
DEPOSIT DE GARANTIE										
CLRNBPEUR	Collatéral esp Recu	6 040 000.000	1.00000	EUR	30/06/2026	6 040 000.00	6 040 000.00			1.26
DFPGBP	Dep gar s/FUT GBP	277 420.000	1.16090	GBP	30/06/2026	318 609.75	322 057.12		3 447.37	0.07
DFPUSD	Dep gar s/FUT USD	986 850.000	0.87466	USD	30/06/2026	864 489.36	863 159.28		-1 330.08	0.18
DFPBNPEUR	Deposit OTC Verse	728 313.200	1.00000	EUR	30/06/2026	728 313.20	728 313.20			0.15
DFPEUR	Gar sur MAT ferm V	59 649.200	1.00000	EUR	30/06/2026	59 649.20	59 649.20			0.01
Total DEPOSIT DE GARANTIE						8 011 061.51	8 013 178.80		2 117.29	1.67
FRAIS DE GESTION										

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
F110EUR	PrComGestFin	-394 073.190	1.00000	EUR	30/06/2026	-394 073.19	-394 073.19			-0.08
F120EUR-	PrN-1ComGestAdm	1 601.640	1.00000	EUR	30/06/2026	1 601.64	1 601.64			
F130EUR-	PrN-1ComGestDep	3 419.710	1.00000	EUR	30/06/2026	3 419.71	3 419.71			
F155EUR-	PrN-1HonoCAC	-3 049.150	1.00000	EUR	30/06/2026	-3 049.15	-3 049.15			

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
Total FRAIS DE GESTION						-392 100.99	-392 100.99			-0.08
Total Liquidites						6 971 748.72	6 974 126.15		2 377.43	1.45
Derives de credit										
CDS										
CDS-00108778	PAR20260409050207052	-18 900 000.000	11.11309	EUR	30/06/2026		-2 100 373.80	-26 250.00	-2 074 123.80	-0.44
Total CDS							-2 100 373.80	-26 250.00	-2 074 123.80	-0.44
Total Derives de credit							-2 100 373.80	-26 250.00	-2 074 123.80	-0.44
Change a terme										
Change a terme										
OACT01993224	OACT 260715 USD/EUR	25 000 000.000	0.87414	USD	30/06/2026	21 311 268.73	21 853 543.49		542 274.76	4.55
OACT01993224	OACT 260715 USD/EUR	-21 311 268.730	1.00000	EUR	30/06/2026	-21 311 268.73	-21 311 268.73			-4.43
OACT02018335	OACT 260715 USD/EUR	-7 876 296.640	1.00000	EUR	30/06/2026	-7 876 296.64	-7 876 296.64			-1.64
OACT02018335	OACT 260715 USD/EUR	9 000 000.000	0.87423	USD	30/06/2026	7 876 296.64	7 868 033.10		-8 263.54	1.64
OVCT01743596	OVCT 260715 USD/EUR	250 016 924.560	1.00000	EUR	30/06/2026	250 016 924.56	250 016 924.56			52.00
OVCT01743596	OVCT 260715 USD/EUR	-293 291 929.000	0.87414	USD	30/06/2026	-250 016 924.56	-256 378 717.03		-6 361 792.47	-53.32
Total Change a terme							-5 827 781.25		-5 827 781.25	-1.21
Total Change a terme							-5 827 781.25		-5 827 781.25	-1.21

v Cours des devises utilisées

Devise	Date du cours	Cours utilisé	Cours inverse
EUR/GBP	30/06/2026	0.86140000	1.16090086
EUR/USD	30/06/2026	1.14330000	0.87466107
USD/EUR	30/06/2026	0.87466107	1.14330000