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 septembre 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 septembre 2026

En notre qualité de commissaire aux comptes du fonds et en application des dispositions de l'article L. 214-17 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 septembre 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.

Signature numérique de
Severine Ernest
KPMG le 09/11/2026 12:11:55

Séverine Ernest
Associée

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

SOCIETE GENERALE
Securities Services

# Inventaire du portefeuille AFER OBLIG MONDE ENTREPRISES au 30/09/2026

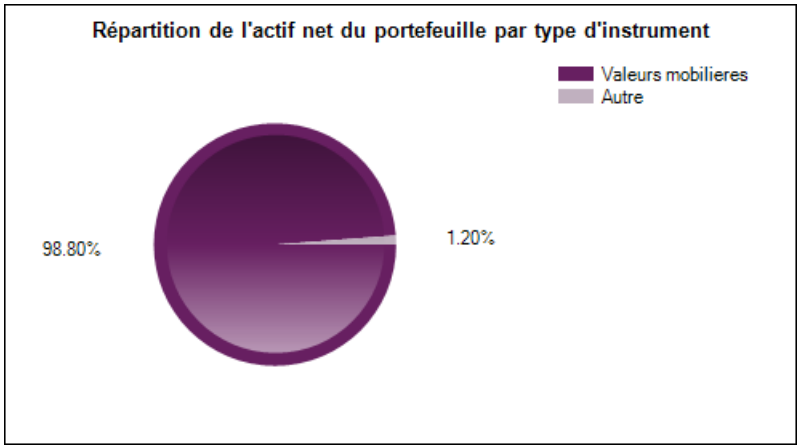
## Descriptif du portefeuille

| Libellé | Code | Actif net | Dev | Statut VL |
|---|---|---|---|---|
| AFER OBLIG MONDE ENTREPRISES | FAMA54 | 436 498 486.04 | EUR | OFF |

## Synthèse

| Part | Code ISIN | VL | Actif de la part | Dev | Nombre de parts |
|---|---|---|---|---|---|
| AG | FR001400RXY5 | 100.91 | 13 379 474.56000 | EUR | 132 583.00 |
| D | FR0011731710 | 98.92 | 422 550 895.21000 | EUR | 4 271 389.9998 |
| DD | FR001400L0S2 | 96.12 | 568 116.27000 | EUR | 5 910.00 |

| Valeur boursière | Prix de revient | +/- value | Intérêts courus |
|---|---|---|---|
| ***Valeurs mobilieres*** | | | |
| 435 467 230.31 | 429 862 923.92 | 3 274 446.49 | 2 329 859.90 |
| ***Coupons*** | | | |
| 102 385.88 | 102 385.88 | | |
| ***Futures*** | | | |
| -2 260 875.12 | | -2 260 875.12 | |
| ***Change a terme*** | | | |
| -2 001 657.36 | | -2 001 657.36 | |
| ***Liquidites*** | | | |
| 5 191 402.33 | 5 162 000.67 | 29 401.66 | |
| **Total** | | | |
| 436 498 486.04 | 435 127 310.47 | -958 684.33 | 2 329 859.90 |



## Détails

| Code valeur | Libellé | Quantité | Cours | Dev | Date du cours | Prix de revient | Valeur boursière | Intérêts courus | +/- value | % Actif |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **Valeurs mobilieres** | | | | | | | | | | |
| ***Obligation*** | | | | | | | | | | |
| US00287YCA55 | ABBVIE INC 4.05% 21/11/2039 | 5 500 000.000 | 81.41700 | USD | 30/09/2026 | 4 417 404.87 | 4 013 181.76 | 70 817.01 | -475 040.12 | 0.92 |
| US02079KBA43 | ALPHABET INC 5.45% 15/11/2055 | 4 500 000.000 | 84.58400 | USD | 30/09/2026 | 3 925 526.11 | 3 432 609.94 | 81 568.87 | -574 485.04 | 0.79 |
| US025816DV84 | AMERICAN EXPRESS CO VAR 26/07/2028 | 5 130 000.000 | 100.05100 | USD | 30/09/2026 | 4 695 128.62 | 4 559 868.90 | 41 124.08 | -176 383.80 | 1.04 |
| US031162DR88 | AMGEN INC 5.25% 02/03/2033 | 2 380 000.000 | 96.88800 | USD | 30/09/2026 | 2 233 699.35 | 2 039 001.47 | 8 861.58 | -203 559.46 | 0.47 |
| US03522AAJ97 | ANHEUSER BUSCH CO NBEV 4.9% 01/02/2046 | 4 500 000.000 | 83.52600 | USD | 30/09/2026 | 3 825 938.62 | 3 341 479.95 | 32 354.62 | -516 813.29 | 0.77 |
| US037833EW60 | APPLE INC 4.85% 10/05/2053 | 4 766 000.000 | 83.49800 | USD | 30/09/2026 | 4 313 516.57 | 3 583 262.60 | 79 706.07 | -809 960.04 | 0.82 |
| US04636NAL73 | ASTRAZENECA FINANCE LLC 4.8% 26/02/2029 | 4 030 000.000 | 99.08400 | USD | 30/09/2026 | 3 752 338.97 | 3 532 233.81 | 16 729.82 | -236 834.98 | 0.81 |
| US00206RCP55 | AT&T INC 4.5% 15/05/2035 | 4 900 000.000 | 88.48200 | USD | 30/09/2026 | 4 008 618.40 | 3 890 406.30 | 73 337.15 | -191 549.25 | 0.89 |
| US00206RMT67 | AT&T INC 5.40% 15/02/2034 | 3 000 000.000 | 95.91500 | USD | 30/09/2026 | 2 791 413.07 | 2 551 525.29 | 18 224.24 | -258 112.02 | 0.58 |
| US05964HBD61 | BANCO SANTANDER SA 6.35% 14/03/2034 | 4 400 000.000 | 99.67200 | USD | 30/09/2026 | 4 203 164.01 | 3 872 660.91 | 11 615.87 | -342 118.97 | 0.89 |
| US06406RBV87 | BANK OF NY MELLON CORP VAR 14/03/2030 | 2 000 000.000 | 98.92800 | USD | 30/09/2026 | 1 859 638.98 | 1 746 056.79 | 4 136.65 | -117 718.84 | 0.40 |
| US06738ECV56 | BARCLAYS PLC VAR 10/09/2035 | 4 600 000.000 | 93.48900 | USD | 30/09/2026 | 4 145 325.75 | 3 798 749.47 | 12 603.41 | -359 179.69 | 0.87 |
| US09659W2P81 | BNP PARIBAS VAR 19/04/2032 | 4 900 000.000 | 87.29300 | USD | 30/09/2026 | 3 935 767.87 | 3 821 510.37 | 55 734.08 | -169 991.58 | 0.88 |
| US101137AL15 | BOSTON SCIENTIFIC 7.375% 15/01/2040 | 2 500 000.000 | 110.38200 | USD | 30/09/2026 | 2 604 283.48 | 2 463 770.40 | 34 268.27 | -174 781.35 | 0.56 |
| US05571AAY10 | BPCE SA VAR 30/05/2035 | 5 100 000.000 | 95.95100 | USD | 30/09/2026 | 4 714 054.38 | 4 397 811.27 | 89 583.07 | -405 826.18 | 1.01 |
| US14739LAB80 | CASCADES INC USA INC 5.375% 15/01/2028 | 224 000.000 | 98.96200 | USD | 30/09/2026 | 190 025.96 | 197 399.89 | 2 237.78 | 5 136.15 | 0.05 |
| US149123CH22 | CATERPILLAR INC 2.6% 09/04/2030 | 3 700 000.000 | 91.24400 | USD | 30/09/2026 | 3 101 023.04 | 3 012 713.14 | 40 465.04 | -128 774.94 | 0.69 |
| US17275RBR21 | CISCO SYSTEMS INC 4.85% 26/02/2029 | 4 122 000.000 | 99.22000 | USD | 30/09/2026 | 3 843 455.61 | 3 617 805.85 | 17 111.75 | -242 761.51 | 0.83 |
| US172967EW71 | CITIGROUP 8.125% 15/07/39 | 4 000 000.000 | 115.73000 | USD | 30/09/2026 | 4 602 048.96 | 4 135 943.22 | 60 405.08 | -526 510.82 | 0.95 |
| US191216DJ60 | COCA COLA CO 1.5% 05/03/2028 | 4 534 000.000 | 95.34300 | USD | 30/09/2026 | 3 819 129.81 | 3 810 154.03 | 4 324.37 | -13 300.15 | 0.87 |
| US126650EB25 | CVS HEALTH CORP 5.40% 01/06/2029 | 2 338 000.000 | 99.77100 | USD | 30/09/2026 | 2 194 346.02 | 2 090 707.38 | 37 050.67 | -140 689.31 | 0.48 |
| US244199BJ37 | DEERE AND COMPANY 3.1% 15/04/2030 | 4 670 000.000 | 92.54500 | USD | 30/09/2026 | 3 988 679.80 | 3 863 720.17 | 58 771.02 | -183 730.65 | 0.89 |
| US251526CX52 | DEUTSCHE BANK NY VAR 11/09/2030 | 5 450 000.000 | 97.96800 | USD | 30/09/2026 | 4 901 087.50 | 4 714 661.84 | 13 991.86 | -200 417.52 | 1.08 |
| US25156PAD50 | DEUTSCHE TELEKOM 9.25% 01/06/2032 | 1 500 000.000 | 116.26200 | USD | 30/09/2026 | 1 742 362.62 | 1 576 070.78 | 40 718.40 | -207 010.24 | 0.36 |
| US532457CR72 | ELI LILLY & CO 4.6% 14/08/2034 | 5 500 000.000 | 93.15700 | USD | 30/09/2026 | 4 890 005.96 | 4 539 917.74 | 29 080.04 | -379 168.26 | 1.04 |
| US30251GBA40 | FMG RESOURCES AUG 2006 4.5% 15/09/2027 | 195 000.000 | 98.62600 | USD | 30/09/2026 | 164 868.82 | 169 662.10 | 343.36 | 4 449.92 | 0.04 |
| US345397G230 | FORD MOTORS CREDIT CO LLC 5.303% 06/09/2029 | 2 400 000.000 | 97.75700 | USD | 30/09/2026 | 2 183 200.74 | 2 073 342.72 | 7 781.25 | -117 639.27 | 0.47 |
| US37045XDE31 | GENERAL MOTORS FINL CO 2.35% 08/01/2031 | 6 438 000.000 | 86.65200 | USD | 30/09/2026 | 4 995 390.92 | 4 942 146.59 | 30 709.55 | -83 953.88 | 1.13 |
| US38141GGM06 | GSACHS G 6.25% 01/02/41 *USD | 4 000 000.000 | 98.15300 | USD | 30/09/2026 | 3 883 058.66 | 3 493 231.21 | 36 683.25 | -426 510.70 | 0.80 |
| US437076DD13 | HOME DEPOT INC 4.85% 25/06/2031 | 4 408 000.000 | 97.57200 | USD | 30/09/2026 | 4 074 929.38 | 3 836 760.04 | 50 191.60 | -288 360.94 | 0.88 |

| Code valeur | Libellé | Quantité | Cours | Dev | Date du cours | Prix de revient | Valeur boursière | Intérêts courus | +/- value | % Actif |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| US404280DW61 | HSBC HOLDINGS PLC VAR 09/03/2044 | 4 400 000.000 | 98.04200 | USD | 30/09/2026 | 4 358 382.72 | 3 812 892.58 | 14 989.69 | -560 479.83 | 0.87 |
| US459200KB68 | IBM CORP 4.15% 15/05/2039 | 5 500 000.000 | 80.04800 | USD | 30/09/2026 | 4 428 334.42 | 3 951 989.95 | 75 914.76 | -552 259.23 | 0.91 |
| US458140CN85 | INTEL CORP 5.0% 21/02/2021 | 2 418 000.000 | 97.18900 | USD | 30/09/2026 | 2 225 477.09 | 2 080 788.26 | 11 826.68 | -156 515.51 | 0.48 |
| US46115HBV87 | INTESA SANPAOLO SPA 8.248% 21/11/2033 | 4 900 000.000 | 109.86500 | USD | 30/09/2026 | 5 137 715.63 | 4 868 009.67 | 128 488.60 | -398 194.56 | 1.12 |
| US46625HHF01 | JPMORGAN CHASE 6.4% 15/05/38 | 5 485 000.000 | 102.38200 | USD | 30/09/2026 | 5 668 856.09 | 5 060 763.14 | 116 754.07 | -724 847.02 | 1.16 |
| US50077LAV80 | KRAFT HEINZ FOODS CO 3.75% 01/04/2030 | 3 436 000.000 | 94.06400 | USD | 30/09/2026 | 2 985 550.62 | 2 845 480.51 |  | -140 070.11 | 0.65 |
| US571676BC81 | MARS INC 5.7% 01/05/2055 | 5 000 000.000 | 89.47100 | USD | 30/09/2026 | 4 508 387.39 | 4 043 051.46 | 104 547.26 | -569 883.19 | 0.93 |
| US58933YBK01 | MERCK CO INC 4.5% 17/05/2033 | 3 609 000.000 | 94.10800 | USD | 30/09/2026 | 3 229 143.46 | 3 043 367.06 | 53 220.72 | -238 997.12 | 0.70 |
| US59217HEC79 | MET LIFE GLOB FOUNDING 1 5.05% 08/01/2034 | 4 800 000.000 | 95.19500 | USD | 30/09/2026 | 4 458 671.60 | 4 072 057.64 | 49 202.51 | -435 816.47 | 0.93 |
| US30303M8V78 | META PLATFORMS INC 5.40% 15/08/2054 | 4 734 000.000 | 77.59200 | USD | 30/09/2026 | 4 400 824.50 | 3 262 640.21 | 28 757.85 | -1 166 942.14 | 0.75 |
| US55305BAS07 | MI HOMES INC 4.95% 01/02/2028 | 200 000.000 | 98.45700 | USD | 30/09/2026 | 168 850.06 | 174 815.34 | 1 452.66 | 4 512.62 | 0.04 |
| US60687YAT64 | MIZUHO FINANCIAL GROUP VAR 11/09/2029 | 4 400 000.000 | 98.01200 | USD | 30/09/2026 | 3 961 546.90 | 3 805 895.73 | 9 154.97 | -164 806.14 | 0.87 |
| US61747YEF88 | MORGAN STAN VAR 16/09/2036 | 6 819 000.000 | 83.11300 | USD | 30/09/2026 | 5 149 159.30 | 4 995 847.29 | 6 213.56 | -159 525.57 | 1.14 |
| US61747YFE05 | MORGAN STANLEY VAR 21/04/2034 | 3 000 000.000 | 95.28900 | USD | 30/09/2026 | 2 702 477.69 | 2 578 395.03 | 61 627.86 | -185 710.52 | 0.59 |
| US636274AE20 | NATIONAL GRID PLC 5.809% 12/06/2033 | 3 000 000.000 | 99.13200 | USD | 30/09/2026 | 2 846 016.51 | 2 664 722.52 | 46 454.27 | -227 748.26 | 0.61 |
| US632525BN08 | NATL AUSTRALIA BANK 4.951% 10/01/2034 | 3 750 000.000 | 95.70900 | USD | 30/09/2026 | 3 476 954.21 | 3 196 603.04 | 36 777.80 | -317 128.97 | 0.73 |
| US68389XCS27 | ORACLE CORP 4.2% 27/09/2029 | 4 474 000.000 | 94.53900 | USD | 30/09/2026 | 4 012 175.62 | 3 725 635.19 | 1 838.16 | -288 378.59 | 0.85 |
| US713448FL73 | PEPSICO INC 3.6% 18/02/2028 | 3 000 000.000 | 98.18300 | USD | 30/09/2026 | 2 698 840.74 | 2 604 560.46 | 11 357.13 | -105 637.41 | 0.60 |
| US716973AF98 | PFIZER INVESTMENT ENTER 5.11% 19/05/2043 | 5 000 000.000 | 87.47600 | USD | 30/09/2026 | 4 392 307.19 | 3 933 163.12 | 82 478.61 | -541 622.68 | 0.90 |
| US771196CM28 | ROCHE HOLDINGS INC 5.128% 08/03/2054 | 3 600 000.000 | 86.95700 | USD | 30/09/2026 | 3 325 254.39 | 2 766 609.50 | 10 566.01 | -569 210.90 | 0.63 |
| US78016EYH43 | ROYAL BANK OF CANADA 2.3% 03/11/2031 | 5 462 000.000 | 85.49000 | USD | 30/09/2026 | 4 272 789.44 | 4 156 455.55 | 45 469.24 | -161 803.13 | 0.95 |
| US83368TBL17 | SOCIETE GENERALE VAR 15/06/2033 | 2 400 000.000 | 98.12300 | USD | 30/09/2026 | 2 264 347.82 | 2 111 998.71 | 38 703.82 | -191 052.93 | 0.48 |
| US86562MCS70 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL CORP INC 5.766% 13/01/2033 | 3 400 000.000 | 99.04900 | USD | 30/09/2026 | 3 305 076.78 | 3 002 282.17 | 37 395.96 | -340 190.57 | 0.69 |
| US87264ADL61 | T MOBILE USA INC 4.2% 01/10/2029 | 2 470 000.000 | 96.66000 | USD | 30/09/2026 | 2 235 795.56 | 2 101 951.84 |  | -133 843.72 | 0.48 |
| BE6300372289 | TELENET FINANCE LUX NOTE 5.5% 01/03/2028 | 200 000.000 | 98.28000 | USD | 30/09/2026 | 123 500.80 | 146 635.24 | 1 734.43 | 21 400.01 | 0.03 |
| US87264ADZ57 | T-MOBILE USA INC 5% 15/02/2036 | 2 400 000.000 | 91.60000 | USD | 30/09/2026 | 2 019 687.18 | 1 948 966.26 | 13 499.43 | -84 220.35 | 0.45 |
| US89236TLZ65 | TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 5.10% 21/03/2031 | 3 524 000.000 | 98.19900 | USD | 30/09/2026 | 3 324 915.19 | 3 051 041.15 | 4 395.24 | -278 269.28 | 0.70 |
| US902613BL18 | UBS GROUP AG VAR 13/09/2030 | 4 300 000.000 | 99.75600 | USD | 30/09/2026 | 4 055 936.82 | 3 787 106.18 | 10 632.17 | -279 462.81 | 0.87 |
| US92343VFR06 | VERIZON COMMUNICATIONS 1.75% 20/01/2031 | 3 000 000.000 | 85.33400 | USD | 30/09/2026 | 2 288 539.95 | 2 262 952.12 | 9 115.79 | -34 703.62 | 0.52 |
| US931142FE87 | WALMART INC 4.5% 15/04/2053 | 5 242 000.000 | 78.18900 | USD | 30/09/2026 | 4 414 093.74 | 3 704 220.52 | 95 762.20 | -805 635.42 | 0.85 |
| US254687FX90 | WALT DISNEY COMPANY 2.65% 13/01/2031 | 5 296 000.000 | 89.47600 | USD | 30/09/2026 | 4 325 554.22 | 4 198 667.81 | 26 771.03 | -153 657.44 | 0.96 |
| USU94303AE12 | WEA FINANACE LLC 3.5% 15/06/2029 | 3 500 000.000 | 94.73500 | USD | 30/09/2026 | 2 934 334.65 | 2 950 912.92 | 31 755.46 | -15 177.19 | 0.68 |

| Code valeur | Libellé | Quantité | Cours | Dev | Date du cours | Prix de revient | Valeur boursière | Intérêts courus | +/- value | % Actif |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| US95000U2Q52 | WELLS FARGO AND COMPANY VAR 30/04/2041 | 4 639 000.000 | 69.90500 | USD | 30/09/2026 | 3 246 742.12 | 2 907 593.59 | 52 557.32 | -391 705.85 | 0.67 |
| US961214EP44 | WESTPAC BANKING CORP VAR 15/11/2035 | 5 438 000.000 | 87.56600 | USD | 30/09/2026 | 4 277 947.82 | 4 240 568.11 | 48 254.80 | -85 634.51 | 0.97 |
| US98212BAM54 | WPX ENERGY INC 5.875% 15/06/2028 | 109 000.000 | 100.09540 | USD | 30/09/2026 | 93 258.15 | 97 714.95 | 1 660.03 | 2 796.77 | 0.02 |

| Code valeur | Libellé | Quantité | Cours | Dev | Date du cours | Prix de revient | Valeur boursière | Intérêts courus | +/- value | % Actif |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ***Total Obligation*** | | | | | | *221 316 879.22* | *205 274 720.75* | *2 329 859.90* | *-18 372 018.37* | *47.03* |
| ***Sicav (O.P.C.V.M.)*** | | | | | | | | | | |
| LU1184721287 | AVIVA INVESTORS SICAV EMERGING MARKETS CORPORATE BOND SICAV | 0.001 | 769.49430 | EUR | 29/09/2026 | 0.97 | 0.77 | | -0.20 | |
| FR001400KPZ3 | OFI INV ESG LIQUIDIT PART I | 2 151.000 | 1 084.49000 | EUR | 30/09/2026 | 2 332 372.54 | 2 332 737.99 | | 365.45 | 0.53 |
| FR0007030663 | OFI INVEST CREDIT EUROPE FCP | 53 356.924 | 663.21000 | EUR | 30/09/2026 | 36 014 264.27 | 35 386 845.50 | | -627 418.77 | 8.11 |
| FR0010645325 | OFI INVEST ESG ALPHA YIELD FCP | 41.900 | 1 689 436.55000 | EUR | 29/09/2026 | 60 345 137.21 | 70 787 391.45 | | 10 442 254.24 | 16.22 |
| FR0010596783 | OFI INVEST ESG EURO HIGH YIELD PART C | 533 477.577 | 133.29000 | EUR | 30/09/2026 | 62 017 586.18 | 71 107 226.28 | | 9 089 640.10 | 16.29 |
| FR0011869163 | OFI INVEST ESG EURO INVESTMENT GRADE CLIMATE FOCUS CH | 1 867.000 | 11 240.84000 | EUR | 30/09/2026 | 19 955 282.30 | 20 986 648.28 | | 1 031 365.98 | 4.81 |
| FR0011024249 | OFI INVEST ISR CREDIT BONDS EURO PART I | 17 081.031 | 1 444.57000 | EUR | 30/09/2026 | 22 976 651.10 | 24 674 745.10 | | 1 698 094.00 | 5.65 |
| FR001400Z826 | OFI INVEST SUB DEBT OPPORTUNITIES PARTS I | 4 789.000 | 1 026.71000 | EUR | 30/09/2026 | 4 904 750.13 | 4 916 914.19 | | 12 164.06 | 1.13 |
| ***Total Sicav (O.P.C.V.M.)*** | | | | | | *208 546 044.70* | *230 192 509.56* | | *21 646 464.86* | *52.74* |
| **Total Valeurs mobilieres** | | | | | | 429 862 923.92 | 435 467 230.31 | 2 329 859.90 | 3 274 446.49 | 99.76 |
| **Coupons** | | | | | | | | | | |
| ***Obligation*** | | | | | | | | | | |
| US50077LAV80 | KRAFT 3.75% 2030 | 3 436.000 | | USD | 30/09/2026 | 56 719.64 | 56 719.64 | | | 0.01 |
| US87264ADL61 | TMUS 4.2 10/01/29 | 2 470.000 | | USD | 30/09/2026 | 45 666.24 | 45 666.24 | | | 0.01 |
| ***Total Obligation*** | | | | | | *102 385.88* | *102 385.88* | | | *0.02* |
| **Total Coupons** | | | | | | 102 385.88 | 102 385.88 | | | 0.02 |
| **Futures** | | | | | | | | | | |
| ***Taux ( Livraison du sous-jacent )*** | | | | | | | | | | |
| DU101226 | EURO SCHATZ 1226 | 680.000 | 104.67500 | EUR | 30/09/2026 | | -253 300.00 | | -253 300.00 | -0.06 |
| G311226 | LONG GILT 1226 | 100.000 | 84.00000 | GBP | 30/09/2026 | | -281 871.35 | | -281 871.35 | -0.06 |
| UXY311226 | US 10YR ULTRA T 1226 | 379.000 | 105.00000 | USD | 30/09/2026 | | -1 725 703.77 | | -1 725 703.77 | -0.40 |
| ***Total Taux ( Livraison du sous-jacent )*** | | | | | | | *-2 260 875.12* | | *-2 260 875.12* | *-0.52* |
| **Total Futures** | | | | | | | -2 260 875.12 | | -2 260 875.12 | -0.52 |
| **Liquidites** | | | | | | | | | | |
| ***APPELS DE MARGES*** | | | | | | | | | | |
| MGEUR | Appel marge EUR | 253 300.000 | 1.00000 | EUR | 30/09/2026 | 253 300.00 | 253 300.00 | | | 0.06 |
| MGGBP | Appel marge GBP | 241 000.000 | 1.16959 | GBP | 30/09/2026 | 280 602.02 | 281 871.35 | | 1 269.33 | 0.06 |
| MGUSD | Appel marge USD | 1 960 142.520 | 0.88040 | USD | 30/09/2026 | 1 707 527.57 | 1 725 705.44 | | 18 177.87 | 0.40 |
| ***Total APPELS DE MARGES*** | | | | | | *2 241 429.59* | *2 260 876.79* | | *19 447.20* | *0.52* |
| ***AUTRES*** | | | | | | | | | | |
| RMF065EUR | Prov com mvts EUR | -2 640.660 | 1.00000 | EUR | 30/09/2026 | -2 640.66 | -2 640.66 | | | |
| ***Total AUTRES*** | | | | | | *-2 640.66* | *-2 640.66* | | | |
| ***BANQUE OU ATTENTE*** | | | | | | | | | | |
| BK065EUR | Banque EUR SGP | -406 526.910 | 1.00000 | EUR | 30/09/2026 | -406 526.91 | -406 526.91 | | | -0.09 |
| BK065GBP | Banque GBP SGP | -213 610.330 | 1.16959 | GBP | 30/09/2026 | -248 694.98 | -249 836.64 | | -1 141.66 | -0.06 |
| BK065USD | Banque USD SGP | 38 952.230 | 0.88040 | USD | 30/09/2026 | 34 164.13 | 34 293.46 | | 129.33 | 0.01 |
| ***Total BANQUE OU ATTENTE*** | | | | | | *-621 057.76* | *-622 070.09* | | *-1 012.33* | *-0.14* |
| ***DEPOSIT DE GARANTIE*** | | | | | | | | | | |
| CLRNBPEUR | Collatéral esp Recu | 2 530 000.000 | 1.00000 | EUR | 30/09/2026 | 2 530 000.00 | 2 530 000.00 | | | 0.58 |
| DFPGBP | Dep gar s/FUT GBP | 210 000.000 | 1.16959 | GBP | 30/09/2026 | 243 531.84 | 245 614.04 | | 2 082.20 | 0.06 |

| Code valeur | Libellé | Quantité | Cours | Dev | Date du cours | Prix de revient | Valeur boursière | Intérêts courus | +/- value | % Actif |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| DFPUSD | Dep gar s/FUT USD | 966 450.000 | 0.88040 | USD | 30/09/2026 | 841 976.00 | 850 860.59 | | 8 884.59 | 0.19 |
| DFPEUR | Gar sur MAT ferm V | 268 978.400 | 1.00000 | EUR | 30/09/2026 | 268 978.40 | 268 978.40 | | | 0.06 |

| Code valeur | Libellé | Quantité | Cours | Dev | Date du cours | Prix de revient | Valeur boursière | Intérêts courus | +/- value | % Actif |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| *Total DEPOSIT DE GARANTIE* | | | | | | *3 884 486.24* | *3 895 453.03* | | *10 966.79* | *0.89* |
| *FRAIS DE GESTION* | | | | | | | | | | |
| F110EUR | PrComGestFin | -340 216.740 | 1.00000 | EUR | 30/09/2026 | -340 216.74 | -340 216.74 | | | -0.08 |
| *Total FRAIS DE GESTION* | | | | | | *-340 216.74* | *-340 216.74* | | | *-0.08* |
| Total Liquidites | | | | | | 5 162 000.67 | 5 191 402.33 | | 29 401.66 | 1.19 |
| Change a terme | | | | | | | | | | |
| *Change a terme* | | | | | | | | | | |
| OACT02039236 | OACT 261014 USD/EUR | -6 793 050.090 | 1.00000 | EUR | 30/09/2026 | -6 793 050.09 | -6 793 050.09 | | | -1.56 |
| OACT02039236 | OACT 261014 USD/EUR | 7 912 684.000 | 0.88000 | USD | 30/09/2026 | 6 793 050.09 | 6 963 164.83 | | 170 114.74 | 1.60 |
| OACT02022203 | OACT 261014 USD/EUR | 34 000 000.000 | 0.87996 | USD | 30/09/2026 | 29 632 268.77 | 29 918 563.75 | | 286 294.98 | 6.85 |
| OACT02022203 | OACT 261014 USD/EUR | -29 632 268.770 | 1.00000 | EUR | 30/09/2026 | -29 632 268.77 | -29 632 268.77 | | | -6.79 |
| OACT02044638 | OACT 261014 USD/EUR | -3 508 717.760 | 1.00000 | EUR | 30/09/2026 | -3 508 717.76 | -3 508 717.76 | | | -0.80 |
| OACT02040452 | OACT 261014 USD/EUR | 10 156.000 | 0.88000 | USD | 30/09/2026 | 8 718.99 | 8 937.30 | | 218.31 | |
| OACT02040452 | OACT 261014 USD/EUR | -8 718.990 | 1.00000 | EUR | 30/09/2026 | -8 718.99 | -8 718.99 | | | |
| OACT02044638 | OACT 261014 USD/EUR | 4 000 000.000 | 0.88002 | USD | 30/09/2026 | 3 508 717.76 | 3 520 079.65 | | 11 361.89 | 0.81 |
| OVCT01763774 | OVCT 261014 USD/EUR | 255 614 860.860 | 1.00000 | EUR | 30/09/2026 | 255 614 860.86 | 255 614 860.86 | | | 58.56 |
| OVCT01763774 | OVCT 261014 USD/EUR | -293 291 929.000 | 0.87996 | USD | 30/09/2026 | -255 614 860.86 | -258 084 508.14 | | -2 469 647.28 | -59.13 |
| *Total Change a terme* | | | | | | | *-2 001 657.36* | | *-2 001 657.36* | *-0.46* |
| Total Change a terme | | | | | | | -2 001 657.36 | | -2 001 657.36 | -0.46 |

## Cours des devises utilisées

| Devise | Date du cours | Cours utilisé | Cours inverse |
|---|---|---|---|
| EUR/GBP | 30/09/2026 | 0.85500000 | 1.16959064 |
| EUR/USD | 30/09/2026 | 1.13585000 | 0.88039794 |
| USD/EUR | 30/09/2026 | 0.88039794 | 1.13585000 |