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

Fonds Commun de Placement AFER CREDIT COURT

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

Fonds Commun de Placement
AFER CREDIT COURT
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 CREDIT COURT

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 09:56:14

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 CREDIT COURT
au 30/09/2026

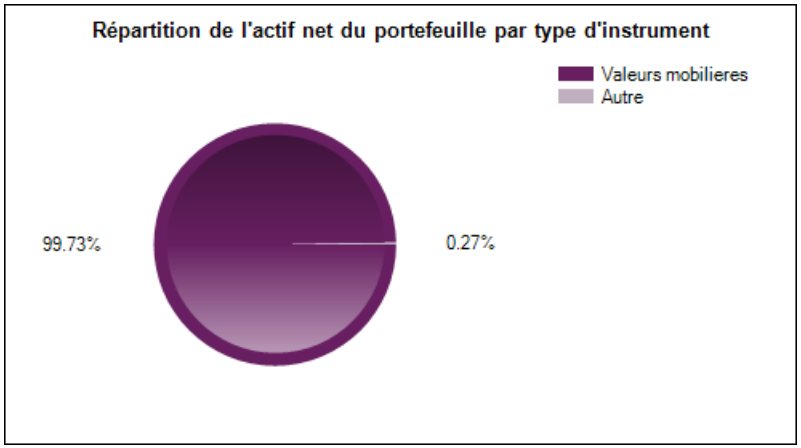
Descriptif du portefeuille

Libellé	Code	Actif net	Dev	Statut VL
AFER CREDIT COURT	OP7361	22 047 293.89	EUR	OFF

Synthèse

Part	Code ISIN	VL	Actif de la part	Dev	Nombre de parts
A	FR001400UIL7	103.07	22 046 270.03000	EUR	213 879.00
C	FR001400UIK9	102.38	1 023.86000	EUR	10.00

Valeur boursière	Prix de revient	+/- value	Intérêts courus
Valeurs mobilieres			
22 001 160.89	22 028 579.46	-276 786.41	249 367.84
Coupons			
6 306.75	6 306.75		
Futures			
-12 729.73		-12 729.73	
Liquidites			
52 555.98	52 555.98		
Total			
22 047 293.89	22 087 442.19	-289 516.14	249 367.84



Détails

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
Valeurs mobilieres										
Obligation										
XS2747181969	ABB FINANCE BV 3.125% 15/01/2029	100 000.000	98.93400	EUR	30/09/2026	100 050.00	101 160.03	2 226.03	-1 116.00	0.46
XS2558022591	ABN AMRO BANK NV VAR 22/02/2033	200 000.000	101.23300	EUR	30/09/2026	208 207.00	208 700.25	6 234.25	-5 741.00	0.95
XS3066564900	ACHMEA BANK NV 2.5% 06/05/2028	200 000.000	98.10500	EUR	30/09/2026	199 368.00	198 251.10	2 041.10	-3 158.00	0.90
XS2958382645	ACHMEA BANK NV 2.75% 10/12/2027	200 000.000	99.07700	EUR	30/09/2026	199 372.00	202 614.27	4 460.27	-1 218.00	0.92
XS2464405229	AIB GROUP PLC VAR 04/04/2028	200 000.000	99.47400	EUR	30/09/2026	197 890.00	201 179.51	2 231.51	1 058.00	0.91
FR0014013VW7	AIR LIQUIDE FINANCE 2.625% 05/11/2029	100 000.000	96.63700	EUR	30/09/2026	99 940.00	99 017.48	2 380.48	-3 303.00	0.45
XS3518480655	ALPHA BANK SA VAR 28/03/2031	105 000.000	99.79200	EUR	30/09/2026	105 000.00	104 832.10	50.50	-218.40	0.48
XS2622275886	AMERICAN TOWER CORP 4.125% 16/05/2027	200 000.000	100.41600	EUR	30/09/2026	118 683.98	118 984.70	1 832.71	-1 531.99	0.54
XS3368960962	AMPHENOL CORP 3.375% 12/05/2029	100 000.000	98.75500	EUR	30/09/2026	99 983.00	100 077.26	1 322.26	-1 228.00	0.45
XS1733289406	ASSICURAZIONI GENERALI SPA VAR 14/12/2047	100 000.000	100.17500	EUR	30/09/2026	102 154.00	103 575.00	3 400.00	-1 979.00	0.47
XS1799611642	AXA SA VAR 28/05/2049	300 000.000	97.22400	EUR	30/09/2026	300 588.00	295 064.47	3 392.47	-8 916.00	1.34
FR0014017YD2	AYVENS SA 3.375% 16/04/2029	100 000.000	98.60000	EUR	30/09/2026	99 762.00	100 162.67	1 562.67	-1 162.00	0.45
FR0014015J87	AYVENS SA 3% 18/04/2030	100 000.000	96.35000	EUR	30/09/2026	99 523.00	97 722.60	1 372.60	-3 173.00	0.44
FR001400RGV6	AYVENS SA 3.875% 16/07/2029	300 000.000	99.55400	EUR	30/09/2026	308 959.00	301 146.25	2 484.25	-10 297.00	1.37
XS3429140398	BANCO BILBAO VIZ 3.375% 30/06/2031	200 000.000	96.23800	EUR	30/09/2026	198 590.00	194 214.36	1 738.36	-6 114.00	0.88
XS2908735504	BANCOSANTANDER SA VAR 02/04/2029	300 000.000	99.23900	EUR	30/09/2026	300 489.00	302 605.36	4 888.36	-2 772.00	1.37
XS2038039074	BANK OF AMERICA CORP VAR 08/08/2029	400 000.000	94.45200	EUR	30/09/2026	369 970.00	378 157.59	349.59	7 838.00	1.72
FR0013408960	BANQUE FED CRED MUTUEL 1.75% 15/03/2029	200 000.000	94.60100	EUR	30/09/2026	190 430.67	191 129.40	1 927.40	-1 228.67	0.87
FR001401B4Q9	BANQUE FED CRED MUTUEL VAR 28/09/2030	100 000.000	99.70200	EUR	30/09/2026	99 953.00	99 748.58	46.58	-251.00	0.45
XS3367720797	BARCLAYS PLC VAR 12/05/2030	200 000.000	98.65900	EUR	30/09/2026	200 874.00	200 123.15	2 805.15	-3 556.00	0.91
BE6340794013	BELFIUS BANQUE SA NV VAR 19/04/2033	100 000.000	101.33100	EUR	30/09/2026	104 665.00	103 718.67	2 387.67	-3 334.00	0.47
XS3075491152	BMW FINANCE NV 2.625% 20/05/2028	239 000.000	98.25700	EUR	30/09/2026	238 469.42	237 154.66	2 320.43	-3 635.19	1.08
FR0014001JT3	BNP PARIBAS VAR 19/01/2030	300 000.000	92.27500	EUR	30/09/2026	269 442.00	277 877.05	1 052.05	7 383.00	1.26
FR0014009HA0	BNP PARIBAS VAR 31/03/2032	100 000.000	99.30100	EUR	30/09/2026	97 966.00	100 568.12	1 267.12	1 335.00	0.46
XS3224498108	BOOKING HOLDINGS INC 3% 07/11/2030	100 000.000	95.74700	EUR	30/09/2026	97 565.00	98 451.11	2 704.11	-1 818.00	0.45
XS3367613448	BOOKING HOLDINGS INC 3.5% 11/05/2030	104 000.000	97.99000	EUR	30/09/2026	103 839.84	103 345.65	1 436.05	-1 930.24	0.47
FR001400FB22	BPCE SA VAR 25/01/2035	200 000.000	101.10000	EUR	30/09/2026	207 360.00	209 220.55	7 020.55	-5 160.00	0.95
XS3108521124	CA AUTO BANK SPA 2.75% 07/07/2028	100 000.000	98.22900	EUR	30/09/2026	99 824.00	98 884.48	655.48	-1 595.00	0.45
XS3275406539	CA AUTOBANK SPA IE 2.75% 21/01/2029	100 000.000	97.57100	EUR	30/09/2026	99 668.00	99 484.70	1 913.70	-2 097.00	0.45
XS2434702424	CAIXABANK SA VAR 21/01/2028	300 000.000	99.25800	EUR	30/09/2026	288 546.00	299 078.79	1 304.79	9 228.00	1.36

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
XS3280995518	CANADIAN IMPERIAL BANK VAR 30/07/2030	251 000.000	97.13800	EUR	30/09/2026	250 683.74	245 116.08	1 299.70	-6 867.36	1.11
FR0014012SB9	CAPGEMINI SE 2.5% 25/09/2028	200 000.000	97.63800	EUR	30/09/2026	199 612.00	195 371.89	95.89	-4 336.00	0.89
XS3231164586	CATERPILLAR FINL 2.541% 20/11/2028	263 000.000	97.68700	EUR	30/09/2026	263 000.00	262 684.18	5 767.37	-6 083.19	1.19
XS3484273183	CATERPILLAR FINL SERVICE 4.404% 28/08/2029	194 000.000	98.81000	EUR	30/09/2026	194 000.00	192 324.64	633.24	-2 308.60	0.87
FR001400XHB4	CCF HOLDINGS SAS VAR 27/05/2035	100 000.000	98.91600	EUR	30/09/2026	101 347.00	100 669.42	1 753.42	-2 431.00	0.46
XS2348237871	CELLNEX FINANCE CO SA 1.5% 08/06/2028	100 000.000	96.42300	EUR	30/09/2026	95 035.00	96 899.71	476.71	1 388.00	0.44
XS2193658619	CELLNEX TELECOM SA 1.875% 26/06/2029	200 000.000	94.47900	EUR	30/09/2026	191 250.00	189 964.85	1 006.85	-2 292.00	0.86
XS3071246295	CENCORA INC 2.875% 22/05/2028	100 000.000	98.63400	EUR	30/09/2026	99 960.00	99 681.60	1 047.60	-1 326.00	0.45
XS3326474155	COCA-COLA HBC FINANCE BV 3.625% 01/10/2030	136 000.000	98.28400	EUR	30/09/2026	135 551.20	133 679.75	13.51	-1 884.96	0.61
XS3232968803	COMPASS GROUP 2.625% 15/01/2029	100 000.000	97.48600	EUR	30/09/2026	99 710.00	99 355.86	1 869.86	-2 224.00	0.45
FR0013517307	CRD MUTUEL ARKEA VAR 11/06/2029	200 000.000	95.71200	EUR	30/09/2026	188 566.00	192 197.97	773.97	2 858.00	0.87
FR0014014P49	CREDIT AGRICOLE SA VAR 03/07/2031	300 000.000	95.45000	EUR	30/09/2026	299 316.00	288 687.33	2 337.33	-12 966.00	1.31
FR001400KDS4	CREDIT AGRICOLE SA VAR 28/08/2033	200 000.000	102.04200	EUR	30/09/2026	213 124.00	205 138.79	1 054.79	-9 040.00	0.93
BE0002936178	CRELAN SA VAR 28/02/2030	100 000.000	104.28800	EUR	30/09/2026	109 940.00	107 838.68	3 550.68	-5 652.00	0.49
XS3081821699	DAIMLER TRUCK INTL 3.0% 27/11/2029	100 000.000	97.17400	EUR	30/09/2026	99 601.00	99 713.73	2 539.73	-2 427.00	0.45
XS3352082930	DANAHER CORP 3.25% 29/04/2030	100 000.000	97.77400	EUR	30/09/2026	99 934.00	99 163.04	1 389.04	-2 160.00	0.45
FR0014017HN6	DANONE SA 3.379% 01/04/2030	100 000.000	98.06400	EUR	30/09/2026	100 000.00	99 767.39	1 703.39	-1 936.00	0.45
FR0014005EJ6	DANONE SA VAR PERPETUAL	300 000.000	99.45500	EUR	30/09/2026	293 850.00	300 748.56	2 383.56	4 515.00	1.36
FR0014019147	DASSAULT SYSTEMS 3.375% 16/06/2031	200 000.000	97.01900	EUR	30/09/2026	199 466.00	196 035.26	1 997.26	-5 428.00	0.89
DE000A4DFH60	DEUTSCHE BANK AG VAR 16/06/2029	300 000.000	98.50400	EUR	30/09/2026	299 761.00	298 175.01	2 663.01	-4 249.00	1.35
XS3086867440	ELM BV FOR JULIUS BAER 3.375% 19/06/2030	100 000.000	96.40200	EUR	30/09/2026	99 517.00	97 372.89	970.89	-3 115.00	0.44
XS3008888953	ENEL FINANCE INTL NV 2.625% 24/02/2028	200 000.000	98.71400	EUR	30/09/2026	199 148.00	200 592.38	3 164.38	-1 720.00	0.91
FR001400A1H6	ENGIE SA 3.5% 27/09/2029	200 000.000	99.00600	EUR	30/09/2026	203 598.00	198 107.89	95.89	-5 586.00	0.90
AT0000A2U543	ERSTE GROUP BANK AG VAR 15/11/2032	100 000.000	97.33100	EUR	30/09/2026	93 412.00	98 100.52	769.52	3 919.00	0.44
DK0030555156	EURONEXT NV 2.625% 26/11/2028	114 000.000	97.59700	EUR	30/09/2026	113 792.52	113 802.16	2 541.58	-2 531.94	0.52
XS1753808929	EXOR NV 1.75% 18/01/2028	100 000.000	97.71200	EUR	30/09/2026	97 224.00	98 944.19	1 232.19	488.00	0.45
XS3517381383	FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.645% 29/10/2029	178 000.000	100.12300	EUR	30/09/2026	177 998.22	178 286.90	67.96	220.72	0.81
XS3036647694	FRESENIUS MEDICAL CARE A 3.125% 08/12/2028	56 000.000	98.50600	EUR	30/09/2026	55 752.48	56 592.13	1 428.77	-589.12	0.26
XS3148184156	GIVAUDAN FIN EUROPE 2.875% 09/09/2029	100 000.000	97.22600	EUR	30/09/2026	99 791.00	97 407.16	181.16	-2 565.00	0.44
XS3379436325	HEIDELBERG MATERIALS AG 3.5% 10/10/2029	132 000.000	98.58400	EUR	30/09/2026	131 795.40	131 751.04	1 620.16	-1 664.52	0.60
DE000A4E0VR6	HENKEL US FINANCE LLC 3.875% 23/09/2029	100 000.000	99.97700	EUR	30/09/2026	99 886.00	100 072.55	95.55	91.00	0.45

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
XS2385390724	HOLDING D INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT SAS 0.75% 16/09/2028	100 000.000	94.20600	EUR	30/09/2026	94 279.00	94 238.88	32.88	-73.00	0.43
XS2788605660	HSBC HOLDINGS PLC VAR 22/03/2035	100 000.000	100.32000	EUR	30/09/2026	104 370.00	102 764.40	2 444.40	-4 050.00	0.47
FR0013320058	ICADE 1.625% 28/02/2028	100 000.000	96.69800	EUR	30/09/2026	97 630.00	97 659.64	961.64	-932.00	0.44
XS3190744907	IDS FINANCING PLC 1% 01/01/2029	118 000.000	96.59200	EUR	30/09/2026	117 561.04	113 989.07	10.51	-3 582.48	0.52
XS2457469547	IMCD NV 2.125% 31/03/2027	100 000.000	99.33300	EUR	30/09/2026	97 633.00	100 410.05	1 077.05	1 700.00	0.46
XS2244936659	INFRASTRUTTURE WIRELESS 1.625% 21/10/2028	300 000.000	95.28900	EUR	30/09/2026	281 500.00	290 488.23	4 621.23	4 367.00	1.32
XS2443920751	ING GROEP NV VAR 16/02/2031	300 000.000	92.47100	EUR	30/09/2026	283 896.00	280 692.45	3 279.45	-6 483.00	1.27
XS2886191589	ING GROEP NV VAR 26/08/2035	100 000.000	98.81200	EUR	30/09/2026	102 610.00	99 242.82	430.82	-3 798.00	0.45
XS2350756446	ING GROUEP NV VAR 09/06/2032	100 000.000	98.42900	EUR	30/09/2026	94 862.00	98 704.68	275.68	3 567.00	0.45
XS2592650373	INTESA SANPAOLO SPA VAR 08/03/2028	150 000.000	100.73800	EUR	30/09/2026	156 172.50	155 380.97	4 273.97	-5 065.50	0.70
XS2931945211	JYSKE BANK AS VAR 05/05/2029	100 000.000	98.69700	EUR	30/09/2026	99 376.00	99 878.51	1 181.51	-679.00	0.45
BE0002914951	KBC GROUP NV VAR 25/4/2033	100 000.000	100.90000	EUR	30/09/2026	103 917.00	103 036.99	2 136.99	-3 017.00	0.47
FR001400KHZ0	KERING 3.625% 05/09/2027	200 000.000	100.17000	EUR	30/09/2026	203 662.00	200 876.30	536.30	-3 322.00	0.91
FR0013512233	KLEPIERRE 2% 12/05/2029	200 000.000	95.05500	EUR	30/09/2026	195 628.00	191 677.12	1 567.12	-5 518.00	0.87
XS2193978363	KONINKLIJKE DSM NV 0.25% 23/06/2028	100 000.000	94.49600	EUR	30/09/2026	91 695.00	94 565.18	69.18	2 801.00	0.43
FR001400HOZ2	LA BANQUE POSTALE 4% 03/05/2028	100 000.000	100.24800	EUR	30/09/2026	103 378.00	101 913.75	1 665.75	-3 130.00	0.46
FR001400ZED2	LVMH MOET HENNESSY VUITT 2.625% 07/03/2029	200 000.000	97.48500	EUR	30/09/2026	199 736.00	197 976.16	3 006.16	-4 766.00	0.90
XS3320664710	MAPLE PARENT HLDS CO 3.881% 26/03/2030	121 000.000	98.44500	EUR	30/09/2026	121 000.00	121 562.95	2 444.50	-1 881.55	0.55
XS3233927733	MITSUBISHI HC CAP UK PLC 2.856% 26/11/2028	250 000.000	97.96200	EUR	30/09/2026	250 000.00	250 969.11	6 064.11	-5 095.00	1.14
FR0013425147	MMS USA FINANCING INC 1.25% 13/06/2028	200 000.000	95.88200	EUR	30/09/2026	189 112.00	192 524.27	760.27	2 652.00	0.87
FR001401B2N0	MMS USA HOLDINGS INC 4.125% 23/09/2030	100 000.000	99.76900	EUR	30/09/2026	99 877.00	99 870.71	101.71	-108.00	0.45
XS2151059206	MONDI FINANCE EUROPE 2.375% 01/04/2028	100 000.000	98.05600	EUR	30/09/2026	97 977.00	99 253.26	1 197.26	79.00	0.45
XS3407449779	MORGAN STANLEY VAR 11/06/2030	121 000.000	98.54100	EUR	30/09/2026	121 000.00	120 540.10	1 305.49	-1 765.39	0.55
XS2548080832	MORGAN STANLEY VAR 25/10/2028	200 000.000	101.31400	EUR	30/09/2026	209 764.00	211 647.43	9 019.43	-7 136.00	0.96
XS3284396622	NATIONAL BANK GREECE SA VAR 04/02/2031	100 000.000	96.28400	EUR	30/09/2026	99 612.00	98 338.79	2 054.79	-3 328.00	0.45
XS2680745119	NATIONAL GRID 4.151% 12/09/2027	200 000.000	100.66500	EUR	30/09/2026	205 750.00	201 784.90	454.90	-4 420.00	0.92
XS3086253039	NATIONAL GRID NA INC 3.15% 03/06/2030	100 000.000	96.81500	EUR	30/09/2026	99 016.00	97 859.25	1 044.25	-2 201.00	0.44
XS2382950330	NATWEST GROUP PLC VAR 14/09/2032	100 000.000	97.84700	EUR	30/09/2026	94 517.00	97 898.44	51.44	3 330.00	0.44
FR001400H0F5	NEXANS SA 5.5% 05/04/2028	200 000.000	101.70600	EUR	30/09/2026	210 760.00	208 836.66	5 424.66	-7 348.00	0.95
XS1550988643	NN GROUP NV VAR 13/01/2048	100 000.000	100.41900	EUR	30/09/2026	103 590.00	103 738.86	3 319.86	-3 171.00	0.47
XS2482618464	NORDEA BANK 2.5% 23/05/2029	300 000.000	96.75600	EUR	30/09/2026	295 165.00	292 980.33	2 712.33	-4 897.00	1.33
PTNOBNOM0009	NOVO BANCO SA VAR 22/01/2031	100 000.000	97.42300	EUR	30/09/2026	99 166.00	99 762.38	2 339.38	-1 743.00	0.45

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
XS3422221294	NTT FINANCE CORP 3.325% 01/11/2029	204 000.000	97.95200	EUR	30/09/2026	204 000.00	201 550.46	1 728.38	-4 177.92	0.91
DK0030566948	NYKREDIT 3.875% 16/09/2030	100 000.000	98.78900	EUR	30/09/2026	99 789.00	98 961.22	172.22	-1 000.00	0.45
XS2354246816	OP CORPORATE BANK PLC 0.375% 16/06/2028	300 000.000	94.64900	EUR	30/09/2026	274 644.00	284 279.88	332.88	9 303.00	1.29
FR0013534484	ORANGE SA 0.125% 16/09/2029	100 000.000	89.75300	EUR	30/09/2026	88 429.00	89 758.48	5.48	1 324.00	0.41
FR001400DAO4	ORANO SA 5.375% 15/05/2027	100 000.000	100.73200	EUR	30/09/2026	104 501.00	102 793.64	2 061.64	-3 769.00	0.47
XS3019313363	PFIZER NETHERLANDS INTL 2.875% 19/05/2029	100 000.000	97.84300	EUR	30/09/2026	99 903.00	98 914.23	1 071.23	-2 060.00	0.45
XS3296830444	PKO BANK POLSKI SA VAR 06/05/2030	103 000.000	98.47100	EUR	30/09/2026	102 956.74	103 001.88	1 576.75	-1 531.61	0.47
FR001400P3D4	RCI BANQUE SA 3.75% 04/10/2027	150 000.000	100.11700	EUR	30/09/2026	151 996.50	155 769.68	5 594.18	-1 821.00	0.71
XS3174782758	RECKITT BENCKISER TSY 2.625% 10/09/2028	114 000.000	98.12000	EUR	30/09/2026	113 873.46	112 037.17	180.37	-2 016.66	0.51
XS3317606419	RELX FINANCE BV 3.25% 22/05/2029	104 000.000	98.53500	EUR	30/09/2026	103 961.52	103 596.89	1 120.49	-1 485.12	0.47
FR0014002OL8	RENAULT SA 2.5% 01/04/2028	100 000.000	97.94900	EUR	30/09/2026	97 523.00	99 209.27	1 260.27	426.00	0.45
XS2494945939	RENTOKIL INITIAL FINANCE 3.875% 27/06/2027	200 000.000	100.28000	EUR	30/09/2026	203 872.00	202 619.59	2 059.59	-3 312.00	0.92
XS2332306344	REXEL SA 2.125% 15/06/2028	100 000.000	96.81300	EUR	30/09/2026	95 676.00	97 444.60	631.60	1 137.00	0.44
XS3406773740	ROYAL BANK OF CANADA VAR 15/06/2030	336 000.000	98.24300	EUR	30/09/2026	336 095.84	333 482.95	3 386.47	-5 999.36	1.51
FR0014016SU0	SANOFI SA 3% 05/05/2029	200 000.000	98.41000	EUR	30/09/2026	199 756.00	199 285.75	2 465.75	-2 936.00	0.90
XS3393867810	SAP SE 3% 03/06/2029	100 000.000	98.22000	EUR	30/09/2026	99 757.00	99 214.52	994.52	-1 537.00	0.45
DE000A2YB7B5	SCHAEFFLER AG 2.875% 26/03/2027	100 000.000	99.53600	EUR	30/09/2026	99 200.00	101 032.58	1 496.58	336.00	0.46
XS2616008970	SIKA CAPITAL BV 3.75% 03/05/2030	200 000.000	99.05200	EUR	30/09/2026	201 516.00	201 227.29	3 123.29	-3 412.00	0.91
XS2297204815	SKF AB 0.25% 15/02/2031	100 000.000	94.66000	EUR	30/09/2026	94 250.00	94 816.85	156.85	410.00	0.43
XS2767499275	SNAM SPA 3.375% 19/02/2028	200 000.000	99.66400	EUR	30/09/2026	202 552.00	203 488.96	4 160.96	-3 224.00	0.92
FR001400U1Q3	SOCIETE GENERALE VAR 13/11/2030	300 000.000	97.76100	EUR	30/09/2026	304 860.00	302 906.63	9 623.63	-11 577.00	1.37
XS2439704318	SSE PLC VAR PERP	200 000.000	99.32000	EUR	30/09/2026	203 660.00	202 234.52	3 594.52	-5 020.00	0.92
XS1207005023	STATKRAFT AS 1.5% 26/03/2030	100 000.000	92.31500	EUR	30/09/2026	94 848.00	93 095.82	780.82	-2 533.00	0.42
FR0013505542	SUEZ 1.25% 02/04/2027	200 000.000	99.09000	EUR	30/09/2026	193 276.00	199 433.42	1 253.42	4 904.00	0.90
XS2522879654	SWEDBANK AB VAR 23/08/2032	100 000.000	99.69100	EUR	30/09/2026	100 978.00	100 088.26	397.26	-1 287.00	0.45
XS2827694170	SWISSCOM FINANCE 3.50% 29/08/20228	100 000.000	99.73600	EUR	30/09/2026	102 269.00	100 062.03	326.03	-2 533.00	0.45
XS2117452156	TELENOR ASA 0.25% 14/02/2028	100 000.000	95.68600	EUR	30/09/2026	92 670.00	95 843.53	157.53	3 016.00	0.43
XS1966038249	TELSTRA CORP LTD 1.375% 26/03/2029	200 000.000	94.47000	EUR	30/09/2026	188 082.00	190 371.51	1 431.51	858.00	0.86
XS2437854487	TERNA RETE ELECTRICA PERP	100 000.000	98.03300	EUR	30/09/2026	98 500.00	99 562.11	1 529.11	-467.00	0.45
XS1652866002	TERNA SPA 1.375% 26/07/2027	100 000.000	98.51800	EUR	30/09/2026	96 744.00	98 774.16	256.16	1 774.00	0.45
FR001401AM07	THALES SA 3.5% 27/08/2030	100 000.000	98.29200	EUR	30/09/2026	99 868.00	98 637.21	345.21	-1 576.00	0.45
XS3498991671	UBER TECHNOLOGIES INC 3.75% 15/09/2029	113 000.000	99.69400	EUR	30/09/2026	112 931.07	112 851.58	197.36	-276.85	0.51
CH1512676888	UBS GROUP AG 3.125% 13/02/2031	200 000.000	96.75700	EUR	30/09/2026	199 742.00	198 000.30	4 486.30	-6 228.00	0.90
BE0002784651	UCB SA 1% 30/03/2028	100 000.000	95.55900	EUR	30/09/2026	95 090.00	96 068.59	509.59	469.00	0.44
FR001400SIM9	UNIBAIL RODAMCO WESTFLD 3.50% 11/09/2029	300 000.000	98.34600	EUR	30/09/2026	305 938.00	295 642.11	604.11	-10 900.00	1.34

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
ES0280907041	UNICAJA BANCO SA VAR 22/06/2034	100 000.000	101.81800	EUR	30/09/2026	103 735.00	103 354.99	1 536.99	-1 917.00	0.47
IT0005689986	UNICREDIT SPA VAR 15/07/2030	138 000.000	96.97500	EUR	30/09/2026	137 693.64	134 684.22	858.72	-3 868.14	0.61
IT0005710055	UNICREDIT SPA VAR 19/05/2036	200 000.000	97.53900	EUR	30/09/2026	200 826.00	198 230.96	3 152.96	-5 748.00	0.90
XS1873209172	UNILEVER NV 1.375% 04/09/2030	200 000.000	91.44200	EUR	30/09/2026	187 496.00	183 094.96	210.96	-4 612.00	0.83
XS3405538888	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV 3.375% 16/06/2030	100 000.000	97.50400	EUR	30/09/2026	99 695.00	98 502.63	998.63	-2 191.00	0.45
XS3423368334	VONOVIA SE 3.5% 06/07/2031	100 000.000	95.78900	EUR	30/09/2026	99 473.00	96 632.84	843.84	-3 684.00	0.44
XS2630465875	WERFEN SA SPAIN 4.625% 06/06/2028	100 000.000	100.90500	EUR	30/09/2026	104 182.00	102 400.21	1 495.21	-3 277.00	0.46

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
Total Obligation						*21 033 773.78*	*21 004 514.58*	*249 367.84*	*-278 627.04*	*95.27*
Sicav (O.P.C.V.M.)										
FR001400KPZ3	OFI INV ESG LIQUIDIT PART I	919.000	1 084.49000	EUR	30/09/2026	994 805.68	996 646.31		1 840.63	4.52
Total Sicav (O.P.C.V.M.)						*994 805.68*	*996 646.31*		*1 840.63*	*4.52*
Total Valeurs mobilieres						22 028 579.46	22 001 160.89	249 367.84	-276 786.41	99.79
Coupons										
Obligation										
XS3326474155	COCA-COLA 3.625% 30	136.000		EUR	30/09/2026	2 471.75	2 471.75			0.01
XS3190744907	IDS FIN PLC 1% 2029	118.000		EUR	30/09/2026	3 835.00	3 835.00			0.02
Total Obligation						*6 306.75*	*6 306.75*			*0.03*
Total Coupons						6 306.75	6 306.75			0.03
Futures										
Taux (Livraison du sous-jacent)										
DU101226	EURO SCHATZ 1226	34.000	104.67500	EUR	30/09/2026		-12 729.73		-12 729.73	-0.06
Total Taux (Livraison du sous-jacent)							*-12 729.73*		*-12 729.73*	*-0.06*
Total Futures							-12 729.73		-12 729.73	-0.06
Liquidites										
APPELS DE MARGES										
MGEUR	Appel marge EUR	12 729.730	1.00000	EUR	30/09/2026	12 729.73	12 729.73			0.06
Total APPELS DE MARGES						*12 729.73*	*12 729.73*			*0.06*
AUTRES										
RMF065EUR	Prov com mvts EUR	-184.720	1.00000	EUR	30/09/2026	-184.72	-184.72			
Total AUTRES						*-184.72*	*-184.72*			
BANQUE OU ATTENTE										
BK065EUR	Banque EUR SGP	30 201.020	1.00000	EUR	30/09/2026	30 201.02	30 201.02			0.14
Total BANQUE OU ATTENTE						*30 201.02*	*30 201.02*			*0.14*
DEPOSIT DE GARANTIE										
DFPEUR	Gar sur MAT ferm V	13 438.700	1.00000	EUR	30/09/2026	13 438.70	13 438.70			0.06
Total DEPOSIT DE GARANTIE						*13 438.70*	*13 438.70*			*0.06*
FRAIS DE GESTION										
F110EUR	PrComGestFin	-3 628.750	1.00000	EUR	30/09/2026	-3 628.75	-3 628.75			-0.02
Total FRAIS DE GESTION						*-3 628.75*	*-3 628.75*			*-0.02*
Total Liquidites						52 555.98	52 555.98			0.24