

OFI INVEST SUB DEBT OPPORTUNITIES

**ATTESTATION DU COMMISSAIRE AUX COMPTES
RELATIVE A LA COMPOSITION DE L'ACTIF DU FCP
AU 31 MARS 2026**

OFI INVEST SUB DEBT OPPORTUNITIES **Fonds Communs de Placement**

OFI INVEST ASSET MANAGEMENT
Société de gestion
127-129, Quai du Président Roosevelt – 92130 ISSY LES MOULINEAUX

ATTESTATION DU COMMISSAIRE AUX COMPTES RELATIVE A LA COMPOSITION DE L'ACTIF DU FCP AU 31 MARS 2026

A la société de gestion,

En notre qualité de commissaire aux comptes du FCP OFI INVEST SUB DEBT OPPORTUNITIES 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 31 mars 2026 ci-jointe.

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.

Fait à Paris, le 26 mai 2026
Le Commissaire aux comptes
APLITEC, représentée par



Maxime GALLET

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Devise de Fixing : WMC IM Closing (EUR)

Devise du portefeuille : EUR

(État simplifié, trame : Devise cotation/Tri comptable(4) --> GLOBALE , Tris : BVAL)

Stock : Stock admi princ[ipa]l au 31/03/26

PORTFEUILLE : OP7439 OFI INVEST SUB DEBT OPPORTUNITIES

VL VALIDEE

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR.	DEV COT	P. R. U EN ET EXPR.	DEVISE	DATE	COURS VALEUR	I F	Devise du portefeuille			PRCT		
										PRDX	REVIENT	TOTA			
										PLUS	OU MOINS	VALEUR	BOUSIERE		
													ACT NET		
EUR															
Obl. & Valeurs ass.															
Autres Obl. & valeurs ass. NMR															
Autres Obl. a taux fixe NMR ou ass.															
BE6363669874	ETHIAS 4.75% 2035	EUR-07/05/35	200,000.	M EUR	102.412	%	31/03/26	100.615			204,824.00	-3,594.00	8,576.39	209,806.39	0.58
DE000A382616	DIF PLESTRIEF 4.0% 28	EVA-27/01/28	300,000.	M EUR	100.851	%	31/03/26	99.308			302,553.00	-4,629.00	2,136.99	300,060.99	0.83
FR001A010XHO	KFC ANFIA 5.07% 2035	EVA-03/07/35	200,000.	M EUR	99.875	%	31/03/26	99.65			199,750.00	-450.00	7,584.16	206,884.16	0.57
IT0005596207	UNIPOLSAI SP 4.9% 34	EVA-23/05/34	200,000.	M EUR	106.451	%	31/03/26	102.467			212,902.00	-7,968.00	8,430.68	213,364.68	0.59
PTFFDDMM0007	FIDELIDADE VAR 46	EVA-17/02/46	400,000.	M EUR	99.052	%	31/03/26	95.696			396,208.00	-13,424.00	2,049.32	384,833.32	1.06
X51042343308	NOVO BANCO 0% 03/51	EUR-06/03/51	400,000.	M EUR	36.75	%	31/03/26	35.612			147,000.00	0.00	0.00	142,448.00	0.39
X53221873600	DOBANK 5.375% 2031	EUR-15/11/31	364,000.	M EUR	100.	%	31/03/26	99.244			364,000.00	-2,751.84	7,608.61	368,856.77	1.02
X53309797622	DANSKE 3.75% 2038	EVA-03/03/38	300,000.	M EUR	96.309	%	31/03/26	95.639			288,927.00	-2,010.00	924.66	287,841.66	0.79
Autres Obl. a taux fixe NMR ou ass.															
Autres Obl. a taux variable revisable NMR ou ass.															
AT0000A3M597	ERSTE 6.375% PERP 99	UST-31/12/99	200,000.	M EUR	102.336	%	31/03/26	101.625			204,672.00	-1,422.00	5,919.64	209,169.64	0.58
BE0390152180	KBC GRP VAR PERP	EVA-31/12/99	400,000.	M EUR	106.04	%	31/03/26	101.69			424,160.00	-17,400.00	1,095.89	407,855.89	1.12
BE6331190973	BELFIUS VAR 04/34	EVA-06/04/34	300,000.	M EUR	92.5	%	31/03/26	92.354			277,500.00	-438.00	3,708.90	280,770.90	0.77
BE6363767821	ACEAS VAR 2036	EVA-02/05/36	200,000.	M EUR	102.776	%	31/03/26	100.163			205,552.00	-5,226.00	8,489.73	208,815.73	0.58
DE000A289M53	ANREAL VAR 2035	EVA-07/05/35	200,000.	M EUR	104.2982	%	31/03/26	101.769			208,596.40	-5,058.40	10,397.26	213,935.26	0.59
DE000A40E982	DEUTSCHE VAR PERP 99	EVA-31/12/99	200,000.	M EUR	104.016	%	31/03/26	101.806			208,032.00	-4,420.00	13,156.85	216,768.85	0.60
DE000CZ45M47	COMMERZBANK VAR PERP	EVA-31/12/99	200,000.	M EUR	97.378	%	31/03/26	98.602			194,756.00	2,448.00	8,336.99	205,540.99	0.57
DE000CZ45M65	COMMER VAR PERP 2099	EVA-31/12/99	400,000.	M EUR	113.375	%	31/03/26	108.605			453,500.00	-19,080.00	30,895.89	465,315.89	1.28
DE000DL19V29	DEUTSCHE BK VAR PERP	EVA-31/12/99	200,000.	M EUR	104.92	%	31/03/26	102.24			419,680.00	-10,720.00	21,998.63	430,958.63	1.19
DN0030523113	NYKREDIT REAL VAR 35	EVA-24/04/35	200,000.	M EUR	101.746	%	31/03/26	99.457			203,492.00	-4,578.00	7,517.81	206,431.81	0.57
ES0840609038	CADYBANK VAR PERP	UST-31/12/99	400,000.	M EUR	96.7425	%	31/03/26	95.676			386,970.00	-4,266.00	748.64	383,452.64	1.06
FR0013534336	ELECTRICITE VAR PERP	UST-31/12/99	200,000.	M EUR	111.113	%	31/03/26	107.116			222,226.00	-7,994.00	3,396.53	217,628.53	0.60
FR0014003XZ7	MUTUELLE VAR 52	EVA-31/12/99	200,000.	M EUR	95.1	%	31/03/26	94.257			190,200.00	-1,686.00	3,680.14	192,194.14	0.53
FR0014005V67	BRCE VAR 2046	EVA-21/06/52	300,000.	M EUR	88.779	%	31/03/26	86.117			266,337.00	-7,986.00	4,977.74	263,328.74	0.73
FR001400MD19	SOCECAP VAR 05/44	EVA-13/10/46	400,000.	M EUR	88.571	%	31/03/26	87.347			354,284.00	-4,896.00	3,982.19	353,370.19	0.97
FR0014000671	BRCE SA VAR 2/36	EVA-16/05/44	200,000.	M EUR	114.499	%	31/03/26	110.731			228,998.00	-7,536.00	11,432.88	232,894.88	0.64
FR001400PT46	GROUPE AOM VAR 2044	EVA-26/02/36	200,000.	M EUR	101.279	%	31/03/26	101.827			202,558.00	1,096.00	934.93	204,588.93	0.56
FR001400QPA3	CCF HOLD VAR PERP	EVA-30/10/44	300,000.	M EUR	105.3592	%	31/03/26	102.124			316,077.60	-9,705.60	6,328.77	312,700.77	0.86
FR001400XBA4	ROQUETTE VAR PERP	EVA-31/12/99	200,000.	M EUR	110.51	%	31/03/26	108.384			221,020.00	-4,252.00	5,626.03	222,394.03	0.61
FR001400XBA4	CCF HOLD VAR PERP	EVA-31/12/99	300,000.	M EUR	101.663	%	31/03/26	99.747			304,989.00	-5,748.00	1,625.62	300,866.62	0.83
FR0014010S83	CNP ASSURAN VAR PERP	UST-27/05/35	100,000.	M EUR	102.238	%	31/03/26	98.233			204,476.00	-8,010.00	2,712.33	199,178.33	0.55
FR00140112W8	SAGECAP SA PERP 2099	UST-31/12/99	200,000.	M EUR	100.881	%	31/03/26	97.743			201,762.00	-6,276.00	2,900.55	198,386.55	0.55
FR0014013681	SECHE ENV VAR 2099	UST-31/12/99	200,000.	M EUR	100.425	%	31/03/26	97.641			200,850.00	-5,568.00	2,706.72	197,988.72	0.55
FR0014013765	BRCE ASSURN VAR PERP	EVA-31/12/99	400,000.	M EUR	100.37	%	31/03/26	97.894			401,480.00	-9,904.00	10,208.22	401,784.22	1.11
FR0014013VFI	BNP PA VAR PERP 2099	UST-31/12/99	300,000.	M EUR	100.85	%	31/03/26	96.913			302,550.00	-11,811.00	7,259.67	297,998.67	0.82
FR0014015D13	BRCE SA VAR 2037	EVA-16/01/37	200,000.	M EUR	100.106	%	31/03/26	97.565			200,212.00	-5,082.00	1,665.75	196,795.75	0.54
IT0005579492	BPER VAR PERP 2099	EVA-31/12/99	200,000.	M EUR	107.2	%	31/03/26	106.45			214,400.00	-1,500.00	3,487.67	216,387.67	0.60
IT0005586729	BANCO VAR 2034	EVA-18/06/34	300,000.	M EUR	102.07	%	31/03/26	101.835			306,210.00	-705.00	11,835.62	317,340.62	0.87
IT0005611758	UNIC VAR PERP 2099	UST-31/12/99	200,000.	M EUR	105.085	%	31/03/26	103.138			210,170.00	-3,894.00	4,273.97	210,549.97	0.58
IT0005657520	BANCA MONTE VAR 2035	EVA-02/10/35	300,000.	M EUR	99.735	%	31/03/26	99.276			299,205.00	-1,377.00	6,544.52	304,372.52	0.84

CUMUL (EUR)

2,116,164.00

37,310.81

2,114,095.97

5.83

Stock : Stock adm principal au 31/03/26
 DEVISE DE FIXING : WC WM Closing (EUR)
 DEVISE DU PORTEFEUILLE : EUR
 (Etat simplifié, trame : Devise cotation/Tri comptable(4) --> GLOBALE , Tris : BVAL)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR.	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR.	DATE COTA	COURS VALEUR	I		PRX REVIENT TOTA	PLUS OU MOINS VAL	Devise du portefeuille		VALEUR BOURSIERE	PRCT ACT NET
								F	F			COURU TOTA	ACT NET		
IT0005689168	UNIPOL A VAR PERP 99	UST-31/12/99	333,000.	M EUR	100.	% 31/03/26	97.248			333,000.00	-9,164.16	3,918.73	327,754.57	0.90	
XS2010028186	SAMPALLSBY VAR PERP	EVA-31/12/99	200,000.	M EUR	73.45	% 31/03/26	67.42			146,900.00	-12,060.00	0.00	134,840.00	0.37	
XS2187689380	VOLKSWAGEN VAR PERP	EVA-31/12/99	200,000.	M EUR	96.21	% 31/03/26	96.204			192,420.00	-12.00	6,136.30	198,544.30	0.55	
XS2380124227	CASTELL VAR PERP	UST-31/12/99	320,000.	M EUR	98.086	% 31/03/26	97.477			313,907.20	-1,980.80	849.32	312,775.72	0.86	
XS2456432413	CO OPERATI VAR PERP	UST-31/12/99	400,000.	M EUR	99.659	% 31/03/26	98.874			398,636.00	-3,140.00	5,035.71	400,531.71	1.10	
XS2549815913	HANNOVER RE VAR 43	EVA-26/08/43	200,000.	M EUR	114.066	% 31/03/26	115.139			228,132.00	-9,694.00	7,050.00	225,488.00	0.62	
XS255481830	ASR NED VAR 2043	EVA-07/12/43	200,000.	M EUR	118.462	% 31/03/26	115.125			236,924.00	-6,654.00	4,449.32	234,719.32	0.65	
XS2602037629	NV GROUP VAR PERP 99	UST-31/12/99	200,000.	M EUR	103.975	% 31/03/26	102.951			207,950.00	-2,048.00	727.58	206,629.58	0.57	
XS2637069357	ACHMEA BV VAR 43	EVA-26/12/43	200,000.	M EUR	116.667	% 31/03/26	112.387			233,334.00	-8,560.00	3,587.67	228,361.67	0.63	
XS2747093321	PIRAEUS VAR 2034	EVA-17/04/34	200,000.	M EUR	105.172	% 31/03/26	106.388			210,344.00	-2,432.00	13,904.11	226,680.11	0.62	
XS2774944008	ABN AMRO VAR PERP	UST-31/12/99	200,000.	M EUR	107.779	% 31/03/26	105.747			215,558.00	-4,064.00	411.01	211,905.01	0.58	
XS2808268380	AIB GROUP VAR PERP	UST-31/12/99	300,000.	M EUR	106.8477	% 31/03/26	104.537			320,543.00	-6,932.00	9,018.49	322,629.49	0.89	
XS2817890077	MUNICH RE VAR 2044	EVA-26/05/44	200,000.	M EUR	102.409	% 31/03/26	99.522			204,818.00	-5,774.00	7,242.47	206,286.47	0.57	
XS2840032762	BANCO BIL VAR PERP	UST-31/12/99	200,000.	M EUR	108.86	% 31/03/26	104.691			217,720.00	-8,338.00	747.28	210,129.28	0.58	
XS2898168443	BANK OF IRLN VAR PERP	UST-31/12/99	200,000.	M EUR	101.649	% 31/03/26	100.888			203,298.00	-1,522.00	803.42	202,579.42	0.56	
XS2901369897	PIRAEUS FIN VAR 2035	EVA-18/09/35	250,000.	M EUR	103.7373	% 31/03/26	101.791			259,343.20	-4,865.70	7,215.75	261,693.25	0.72	
XS2913056797	KOVINKLITJE PERP	EVA-31/12/99	300,000.	M EUR	101.0899	% 31/03/26	99.304			303,269.62	-5,357.62	2,750.55	300,662.55	0.83	
XS2975137964	ENEL VAR PERP 99	EVA-31/12/99	200,000.	M EUR	101.55	% 31/03/26	97.24			203,100.00	-8,620.00	1,923.29	196,403.29	0.54	
XS2980761956	ACHMEA BV VAR PERP	UST-31/12/99	380,000.	M EUR	99.539	% 31/03/26	99.498			378,248.20	-155.80	4,114.92	382,207.32	1.05	
XS3011202655	ASR NED VAR PERP 99	EVA-31/12/99	550,000.	M EUR	102.6574	% 31/03/26	101.856			564,615.50	-4,407.50	0.00	560,208.00	1.54	
XS3016984372	CAIXABANK 4% 37	EVA-05/03/37	200,000.	M EUR	97.488	% 31/03/26	97.765			194,976.00	554.00	613.70	196,143.70	0.54	
XS3021369809	BANK OF IRELA PERP	EVA-31/12/99	300,000.	M EUR	98.625	% 31/03/26	99.196			295,875.00	1,713.00	755.14	298,343.14	0.82	
XS3037646661	BANCO DE VAR PERP	UST-31/12/99	600,000.	M EUR	103.3827	% 31/03/26	101.128			620,296.00	-13,528.00	4,380.82	611,148.82	1.68	
XS3073350269	HSBC HOLDINGS VAR 36	EVA-19/05/36	300,000.	M EUR	99.688	% 31/03/26	99.067			299,064.00	-1,863.00	10,954.01	308,155.01	0.85	
XS3074459594	ABERTIS VAR PERP 99	EVA-31/12/99	200,000.	M EUR	102.2925	% 31/03/26	98.687			204,585.00	-7,211.00	988.21	198,362.21	0.55	
XS3099152756	BANKINTE VAR PERP 99	UST-31/12/99	200,000.	M EUR	100.	% 31/03/26	99.637			200,000.00	-726.00	97.83	199,371.83	0.55	
XS3100756637	BANCO PERP VAR 99	UST-31/12/99	400,000.	M EUR	101.2333	% 31/03/26	99.603			404,933.33	-6,521.33	0.00	398,412.00	1.10	
XS3103647031	PIRAEUS FIN VAR PERP	EUR-31/12/99	300,000.	M EUR	103.848	% 31/03/26	100.518			311,544.00	-9,990.00	5,175.00	306,729.00	0.85	
XS3106543534	LENZING AG PERP 2099	UST-31/12/99	300,000.	M EUR	100.21	% 31/03/26	99.134			300,630.00	-3,228.00	6,190.61	303,592.61	0.84	
XS3124434492	ALPHA BANK VAR 36	EVA-23/07/36	300,000.	M EUR	100.72	% 31/03/26	97.023			302,160.00	-11,091.00	8,958.28	300,027.28	0.83	
XS3200187576	ALPHA BANK VAR 2037	EVA-13/10/37	600,000.	M EUR	99.8695	% 31/03/26	96.86			599,217.00	-18,057.00	11,946.58	593,106.58	1.64	
XS3204041266	DZ BANK VAR 2035	EVA-15/10/35	200,000.	M EUR	100.	% 31/03/26	98.222			200,000.00	-3,556.00	3,431.86	199,875.86	0.55	
XS3223939466	MERCK KGAA VAR 2055	EVA-24/11/55	300,000.	M EUR	99.779	% 31/03/26	97.199			299,337.00	-7,740.00	1,140.41	292,737.41	0.81	
XS3224517410	EUROBANK PERP 99	UST-31/12/99	300,000.	M EUR	100.965	% 31/03/26	95.403			302,895.00	-16,686.00	7,406.77	293,615.77	0.81	
XS3227335422	PRO BANK VAR 2032	EVA-20/11/32	190,000.	M EUR	99.725	% 31/03/26	96.639			189,477.50	-5,863.40	2,509.69	186,123.79	0.51	
XS3246991981	GRAND VAR PERP 2099	EVA-31/12/99	310,000.	M EUR	97.976	% 31/03/26	93.041			303,725.60	-15,298.50	4,639.38	293,066.48	0.81	
XS3277939420	RAIFFEISEN VAR 32	EVA-22/01/32	300,000.	M EUR	100.	% 31/03/26	98.227			300,000.00	-5,319.00	2,379.62	297,060.62	0.82	
XS3298382931	INTESA SANI PERP	UST-31/12/99	200,000.	M EUR	100.	% 31/03/26	94.85			200,000.00	-10,300.00	1,337.02	191,037.02	0.53	
XS3307414816	STELLANTIS VAR PERP	EVA-31/12/99	204,000.	M EUR	99.254	% 31/03/26	94.486			202,478.16	-9,726.72	653.22	193,404.66	0.53	
Autres Obl. a taux variable revisable NIMR ou ass.											-418,203.53		19,388,664.92	53.45	
CUMUL (EUR)											374,077.14		19,388,664.92	53.45	

Stock : Stock admn principal au 31/03/26
 PORTEFEUILLE : OP7439 OFI INVEST SUB DEBT OPPORTUNITIES

Devise de Fixing : WIC IM Closing (EUR)
 Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifié, trame : Devise cotation/Tri comptable(4) --> GLOBALE , Tris : BVAL)

V	A	L	E	U	R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR.	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR.	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	PREX REVIENT TOTA	PLUS OU MOINS VAL	COUPON COURU TOTA	VALEUR BOURSIERE	PRCT ACT NET	
Contrats de swap de taux																			
Instruments financiers a terme																			
Tresorerie																			
Liquidites																			
Dettes et comptes rattachés																			
Achats Devises a terme																			
0ACT01966513	0ACT	15/04/26	15/04/26	USD	0.8506	290,000.	0.8506	31/03/26	0.86735491	0.86735491	31/03/26	0.86735491	0.86735491	246,688.29	4,844.63	0.00	0.00	251,532.92	0.69
0ACT01974818	0ACT	15/04/26	15/04/26	EUR	1.	-246,688.29	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	-246,688.29	0.00	0.00	0.00	-246,688.29	-0.68
0ACT01975259	0ACT	15/04/26	15/04/26	USD	0.8403	200,000.	0.8403	31/03/26	0.86738645	0.86738645	31/03/26	0.86738645	0.86738645	168,061.52	5,415.77	0.00	0.00	173,477.29	0.48
0ACT01975615	0ACT	15/04/26	15/04/26	EUR	1.	-168,061.52	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	-168,061.52	0.00	0.00	0.00	-168,061.52	-0.46
0ACT01975616	0ACT	15/04/26	15/04/26	GBP	1.145	315,000.	1.145	31/03/26	1.1438437	1.1438437	31/03/26	1.1438437	1.1438437	360,675.39	-364.62	0.00	0.00	360,310.77	0.99
0ACT01975617	0ACT	15/04/26	15/04/26	EUR	1.	-360,675.39	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	-360,675.39	0.00	0.00	0.00	-360,675.39	-0.99
0ACT01975618	0ACT	15/04/26	15/04/26	GBP	1.1453	440,000.	1.1453	31/03/26	1.14386075	1.14386075	31/03/26	1.14386075	1.14386075	503,911.67	-612.94	0.00	0.00	503,298.73	1.39
0ACT01975619	0ACT	15/04/26	15/04/26	EUR	1.	-503,911.67	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	-503,911.67	0.00	0.00	0.00	-503,911.67	-1.39
0ACT01975620	0ACT	15/04/26	15/04/26	USD	0.8438	115,000.	0.8438	31/03/26	0.86736342	0.86736342	31/03/26	0.86736342	0.86736342	97,040.36	2,706.43	0.00	0.00	99,746.79	0.27
0ACT01975621	0ACT	15/04/26	15/04/26	EUR	1.	-97,040.36	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	-97,040.36	0.00	0.00	0.00	-97,040.36	-0.27
0ACT01975622	0ACT	15/04/26	15/04/26	GBP	1.1428	160,000.	1.1428	31/03/26	1.14387768	1.14387768	31/03/26	1.14387768	1.14387768	182,845.94	174.49	0.00	0.00	183,020.43	0.50
0ACT01975623	0ACT	15/04/26	15/04/26	EUR	1.	-182,845.94	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	-182,845.94	0.00	0.00	0.00	-182,845.94	-0.50
0ACT01975624	0ACT	15/04/26	15/04/26	GBP	1.142	300,000.	1.142	31/03/26	1.14384346	1.14384346	31/03/26	1.14384346	1.14384346	342,595.71	557.33	0.00	0.00	343,153.04	0.95
0ACT01975625	0ACT	15/04/26	15/04/26	EUR	1.	-342,595.71	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	-342,595.71	0.00	0.00	0.00	-342,595.71	-0.94
0ACT01975626	0ACT	15/04/26	15/04/26	USD	0.8623	425,000.	0.8623	31/03/26	0.86737398	0.86737398	31/03/26	0.86737398	0.86737398	366,461.13	2,172.81	0.00	0.00	368,633.94	1.02
0ACT01975627	0ACT	15/04/26	15/04/26	EUR	1.	-366,461.13	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	-366,461.13	0.00	0.00	0.00	-366,461.13	-1.01
Achats reglements differes																			
BDS065EUR	Ach diff	titres	EUR	EUR	1.	-281,208.9	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	-281,208.90	0.00	0.00	0.00	-281,208.90	-0.78
Dettes et comptes rattachés																			
Creances et comptes rattachés																			
Ventes Devises a terme																			
0ACT01721221	0ACT	15/04/26	15/04/26	EUR	1.	4,070,349.4	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	4,070,349.40	0.00	0.00	0.00	4,070,349.40	11.22
0ACT01721222	0ACT	15/04/26	15/04/26	GBP	1.1466	-3,550,000.	1.1466	31/03/26	1.14379612	1.14379612	31/03/26	1.14379612	1.14379612	-4,070,349.40	9,873.18	0.00	0.00	-4,060,476.22	-11.19
0ACT01721262	0ACT	15/04/26	15/04/26	EUR	1.	4,226,709.09	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	4,226,709.09	0.00	0.00	0.00	4,226,709.09	11.65
0ACT01721263	0ACT	15/04/26	15/04/26	USD	0.8522	-4,960,000.	0.8522	31/03/26	0.86735598	0.86735598	31/03/26	0.86735598	0.86735598	-4,226,709.09	-75,376.56	0.00	0.00	-4,302,085.65	-11.86
0ACT01721264	0ACT	15/04/26	15/04/26	EUR	1.	341,827.11	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	341,827.11	0.00	0.00	0.00	341,827.11	0.94
0ACT01721265	0ACT	15/04/26	15/04/26	USD	0.8546	-400,000.	0.8546	31/03/26	0.86735292	0.86735292	31/03/26	0.86735292	0.86735292	-341,827.11	-5,114.06	0.00	0.00	-346,941.17	-0.96
0ACT01721266	0ACT	15/04/26	15/04/26	EUR	1.	275,590.82	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	275,590.82	0.00	0.00	0.00	275,590.82	0.76
0ACT01721267	0ACT	15/04/26	15/04/26	GBP	1.1483	-240,000.	1.1483	31/03/26	1.14381047	1.14381047	31/03/26	1.14381047	1.14381047	-275,590.82	1,076.31	0.00	0.00	-274,514.51	-0.76
0ACT01721268	0ACT	15/04/26	15/04/26	EUR	1.	356,535.23	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	356,535.23	0.00	0.00	0.00	356,535.23	0.98
0ACT01721269	0ACT	15/04/26	15/04/26	GBP	1.1501	-310,000.	1.1501	31/03/26	1.14381947	1.14381947	31/03/26	1.14381947	1.14381947	-356,535.23	1,951.20	0.00	0.00	-354,584.03	-0.98
0ACT01721270	0ACT	15/04/26	15/04/26	EUR	1.	84,417.9	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	84,417.90	0.00	0.00	0.00	84,417.90	0.23
0ACT01721271	0ACT	15/04/26	15/04/26	USD	0.8442	-100,000.	0.8442	31/03/26	0.86738379	0.86738379	31/03/26	0.86738379	0.86738379	-84,417.90	-2,320.48	0.00	0.00	-86,738.38	-0.24
0ACT01721272	0ACT	15/04/26	15/04/26	EUR	1.	281,616.95	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	281,616.95	0.00	0.00	0.00	281,616.95	0.78
0ACT01721273	0ACT	15/04/26	15/04/26	USD	0.8406	-335,000.	0.8406	31/03/26	0.86737071	0.86737071	31/03/26	0.86737071	0.86737071	-281,616.95	-8,952.24	0.00	0.00	-290,569.19	-0.80
0ACT01731542	0ACT	15/04/26	15/04/26	EUR	1.	361,118.38	1.	31/03/26	1.	1.	31/03/26	1.	1.	361,118.38	0.00	0.00	0.00	361,118.38	1.00

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock adm principal au 31/03/26
 DEVISE DE FIXING : WMC IM Closing (EUR)
 DEVISE DU PORTEFEUILLE : EUR
 (Etat simplifié, trame : Devise cotation/Tri comptable(4) --> GLOBALE , Tris : BVAL)

V	A	L	E	U	R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR.	DEV COT	P.R.U EN EXPR.	DEVISE COURSE	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	PRX REVIENT TOTA	PLUS OU MOINS VAL	Devise du portefeuille	COUPON COURRU TOTA	VALEUR BOURSIERE	PRCT ACT NET	
						VERSE 15/04/26		-425,000.	USD	0.8497		31/03/26	0.86735257		-361,118.38	-7,506.46	0.00	0.00	-368,624.84	-1.02	
						RECUP 15/04/26		160,308.61	EUR	1.		31/03/26	1.		160,308.61	0.00	0.00	0.00	160,308.61	0.44	
						VERSE 15/04/26		-185,000.	USD	0.8665		31/03/26	0.86733734		-160,308.61	-148.80	0.00	0.00	-160,457.41	-0.44	
						RECUP 15/04/26		345,484.8	EUR	1.		31/03/26	1.		345,484.80	0.00	0.00	0.00	345,484.80	0.95	
						VERSE 15/04/26		-300,000.	GBP	1.1516		31/03/26	1.14383438		-345,484.80	2,334.49	0.00	0.00	-343,150.31	-0.95	
						RECUP 15/04/26		692,475.3	EUR	1.		31/03/26	1.		692,475.30	0.00	0.00	0.00	692,475.30	1.91	
						VERSE 15/04/26		-600,000.	GBP	1.1541		31/03/26	1.14384043		-692,475.30	6,171.04	0.00	0.00	-686,304.26	-1.89	
						RECUP 15/04/26		172,226.59	EUR	1.		31/03/26	1.		172,226.59	0.00	0.00	0.00	172,226.59	0.47	
						VERSE 15/04/26		-200,000.	USD	0.8611		31/03/26	0.86737499		-172,226.59	-1,248.41	0.00	0.00	-173,475.00	-0.48	
						RECUP 15/04/26		610,047.84	EUR	1.		31/03/26	1.		610,047.84	0.00	0.00	0.00	610,047.84	1.68	
						VERSE 15/04/26		-700,000.	USD	0.8715		31/03/26	0.86740766		-610,047.84	2,862.48	0.00	0.00	-607,185.36	-1.67	
						RECUP 15/04/26		242,955.48	EUR	1.		31/03/26	1.		242,955.48	0.00	0.00	0.00	242,955.48	0.67	
						VERSE 15/04/26		-280,000.	USD	0.8677		31/03/26	0.8674095		-242,955.48	80.82	0.00	0.00	-242,874.66	-0.67	
						Coupons a recevoir															
						XS3011202655 ASR NEDE VAR PERP 99		550.	P EUR	32.5		31/03/26	A		17,875.00	0.00	0.00	0.00	17,875.00	0.05	
						XS3100756637 BANCO PERP VAR 99		2.	P EUR	3000.		31/03/26	A		6,000.00	0.00	0.00	0.00	6,000.00	0.02	
						Ventes reglements differes															
						SOC065EUR Vte regl diff dev		-243,115.07	EUR	1.		31/03/26	1.		-243,115.07	0.00	0.00	0.00	-243,115.07	-0.67	
						SOS063EUR Vte diff titres EUR		1,517,222.92	EUR	1.		31/03/26	1.		1,517,222.92	0.00	0.00	0.00	1,517,222.92	4.18	
						Deposits de garantie (recus)															
						DFPBNPEUR Deposit OTC Verse		1,754,071.8	EUR	1.		31/03/26	1.		1,754,071.80	0.00	0.00	0.00	1,754,071.80	4.84	
						DFPEUR Dep par s/EUR EUR		30,874.6	EUR	1.		31/03/26	1.		30,874.60	0.00	0.00	0.00	30,874.60	0.09	
						Creances et comptes rattachés															
						RWF065EUR Debitors et creditors divers		-2,566.61	EUR	1.		31/03/26	1.		-2,566.61	0.00	0.00	0.00	-2,566.61	-0.01	
						RWF065EUR Prov com mvts EUR															
						RWF065EUR Debitors et creditors divers		-2,566.61	EUR						-2,566.61	0.00	0.00	0.00	-2,566.61	-0.01	
						Comptes d ajustement															
						F110EUR Frais provisionnes		-12,045.86	EUR	1.		31/03/26	1.		-12,045.86	0.00	0.00	0.00	-12,045.86	-0.03	
						F110EUR PrComFestFin															
						Comptes d ajustement															
						Liquidites															
								2,787,107.88	EUR						2,787,107.88	-61,423.59	0.00	0.00	2,725,684.29	7.51	
						Autres disponibilites															
						Comptes financiers															
						Operations a vue															
						BK065EUR Banque EUR SQP		-676,651.47	EUR	1.		31/03/26	1.		-676,651.47	0.00	0.00	0.00	-676,651.47	-1.87	

Inventaire sur historique de valorisation (HISIMV)

Stock : Stock admn principal au 31/03/26
 Devise de Fixing : WAC Int Closing (EUR)
 Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifié, trame : Devise cotation/Tri comptable(4) --> GLOBALE , Tris : BVAL)

VL VALIDEE

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P. R. U EN EXPR. ET EXPR.	EN DEVISE COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	Devise du portefeuille		PRCT	
										PRDX REVIENT TOTA	PLUS OU MOINS VAL		COUPON COURU TOTA
Appel de marge													
MGNPEUR	Appel de marge EUR		274,247.09	EUR	1.		31/03/26	1.			0.00	274,247.09	0.76
MCEUR	Appel marge EUR		-73,980.	EUR	1.		31/03/26	1.			0.00	-73,980.00	-0.20
Comptes financiers													
Autres disponibilités													
Tresorerie													
EURO													
LIVRE STERLING													
Obli. & Valeurs ass.													
Autres Obli. & valeurs ass. NMR													
Autres Obli. a taux fixe NMR ou ass.													
XS2534883363	INTESA 8.50% 09/32	UST-20/09/32	200,000.	M GBP	115.869	%	31/03/26	113.423			0.00	266,871.65	0.72
XS2621758635	ROTHESAY 7.73%# 2033	EXA-16/05/33	100,000.	M GBP	110.199	%	31/03/26	106.867			0.00	126,862.37	0.36
Autres Obli. a taux fixe NMR ou ass.													
Autres Obli. a taux variable revisable NMR ou ass.													
FR0014015DN2	CREDIT VAR 2037	EXA-20/12/37	300,000.	M GBP	99.482	%	31/03/26	95.841			0.00	344,268.08	0.92
XS2181348405	AVIVA PLC VAR 06/55	UST-03/06/55	200,000.	M GBP	86.028	%	31/03/26	83.66			0.00	197,368.51	0.54
XS2393498204	ROTHESAY LF VAR PERP	EXA-31/12/99	200,000.	M GBP	89.15	%	31/03/26	87.152			0.00	202,544.59	0.56
XS2552367687	BARCLAYS VAR 32	EXA-14/11/32	400,000.	M GBP	104.316	%	31/03/26	104.209			0.00	482,218.88	1.36
XS2702921607	COOPERATIVE VAR 34	UST-22/05/34	400,000.	M GBP	119.844	%	31/03/26	114.667			0.00	562,647.89	1.50
XS2826591740	COMVENT VAR PERP	EXA-31/12/99	400,000.	M GBP	105.065	%	31/03/26	102.771			0.00	493,262.91	1.33
XS2902577191	NATWEST GRP VAR 34	EXA-17/10/34	200,000.	M GBP	100.021	%	31/03/26	99.781			0.00	231,115.48	0.65
XS3013997686	LLOYDS VAR PERP 99	EUR-31/12/99	300,000.	M GBP	100.625	%	31/03/26	99.495			0.00	347,842.37	0.94
XS3016221981	NATWEST VAR PERP 99	EXA-31/12/99	200,000.	M GBP	102.375	%	31/03/26	102.44			0.00	234,872.38	0.63
XS3069217621	BARCLAYS PERP 2099	EUR-31/12/99	300,000.	M GBP	105.3497	%	31/03/26	102.44			0.00	365,155.07	0.97
XS3086813436	NATIONALWID VAR PERP	EXA-31/12/99	200,000.	M GBP	104.099	%	31/03/26	100.709			0.00	236,871.27	0.65
XS3202737493	NATIONWIDE VAR 2036	UST-14/07/36	200,000.	M GBP	99.9405	%	31/03/26	98.083			0.00	230,184.83	0.63
XS3307415110	STELLA VAR PERP 99	EXA-31/12/99	157,000.	M GBP	99.472	%	31/03/26	95.763			0.00	180,429.83	0.48
Autres Obli. a taux variable revisable NMR ou ass.													
Autres Obli. & valeurs ass. NMR													
Autres Obli. & valeurs ass. NMR													

Inventaire sur historique de valorisation (HESINV)

Stock : Stock admi principal au 31/03/26
 Devise de Fixing : IWC IM Closing (EUR)
 Devise du portefeuille : EUR
 (Etat simplifié, trame : Devise cotation/Tri comptable(4) --> GLOBALE , Tris : BVAL)

V	A	L	E	R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	←----- PRX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille PLUS OU MOINS VAL	COUPON COURU TOTA	-----> VALEUR BOURSIERE	PRCT ACT NET
Obi. & Valeurs ass.																	
Tresorerie																	
Autres disponibilités																	
Comptes financiers																	
Operations a vue																	
8K065GBP					GBP	1.15493196	34,905.71			31/03/26	1.14455763		40,313.72	-362.12	0.00	39,951.60	0.11
Banque GBP SCP																	
Comptes financiers																	
Autres disponibilités																	
Tresorerie																	
Autres disponibilités																	
LIVRE STERLING																	
DOLLAR DES ETATS-UNIS																	
Obi. & Valeurs ass.																	
Autres Obi. & Valeurs ass. NMR																	
Autres Obi. a taux fixe NMR ou ass.																	
US461154RQ2					M USD	95.55	300,000.			% 31/03/26	93.652		246,559.44	-2,716.35	3,643.46	247,486.55	0.68
INTESA S 4.198% 6/32 USA-01/06/32																	
Autres Obi. a taux fixe NMR ou ass.																	
Autres Obi. a taux variable revisable NMR ou ass.																	
US00084DV29					M USD	89.491	200,000.			% 31/03/26	89.501		156,104.84	-748.13	288.49	155,645.20	0.43
ARW ANRO VAR 03/37 EUR-13/03/37																	
US0565ALQ49					M USD	91.165	400,000.			% 31/03/26	90.448		316,454.53	-2,453.49	1,562.23	315,563.27	0.87
BNP PARIBAS PERP EUR-31/12/99																	
US0597K4L35					M USD	89.916	400,000.			% 31/03/26	89.822		313,692.38	-1,864.57	4,011.89	315,839.70	0.87
SANTAN VAR 11/32 USA-22/11/32																	
US06417X4G80					M USD	95.7968	400,000.			% 31/03/26	95.736		329,773.13	2,585.84	6,503.84	338,862.81	0.93
BK OF NOMA VAR 5/37 USA-04/05/37																	
US4042800559					M USD	117.565	200,000.			% 31/03/26	114.41		200,734.19	-2,140.19	5,789.52	204,383.52	0.56
HSBC HOLDINGS VAR 33 EUR-03/11/33																	
US404280FH76					M USD	100.	200,000.			% 31/03/26	99.		173,550.85	-1,705.69	227.83	172,072.99	0.47
HSBC HOLD PERP 2099 EUR-31/12/99																	
US456837AY94					M USD	95.872	200,000.			% 31/03/26	96.141		166,712.16	170.32	2,522.35	169,404.83	0.47
ING GRP VAR PERP EUR-31/12/99																	
US639057AT53					M USD	106.375	200,000.			% 31/03/26	101.6		180,319.53	-3,961.26	35.20	176,393.47	0.49
NATWEST GRP PERP 99 USA-31/12/99																	
US65559CAD39					M USD	94.515	200,000.			% 31/03/26	92.985		163,210.16	-1,805.89	542.44	161,946.71	0.45
NORDE VAR PERP 12/99 EUR-31/12/99																	
US83370RAE80					M USD	105.0863	300,000.			% 31/03/26	103.013		268,902.79	-686.34	7,639.37	275,855.82	0.76
SOCIETE GEN VAR PERP EUR-31/12/99																	
US83370RAF55					M USD	100.	200,000.			% 31/03/26	96.206		171,431.02	-4,435.70	2,645.30	169,640.62	0.47
SOCIETE VAR PERP 99 USA-31/12/99																	
US902613BN73					M USD	100.209	200,000.			% 31/03/26	99.667		173,102.44	-99.49	693.60	173,696.55	0.48
UBS GROUP PERP 2099 EUR-31/12/99																	
US902613BV99					M USD	100.1631	217,000.			% 31/03/26	97.178		185,765.95	-2,745.42	2,876.69	185,897.22	0.51
UBS GROUP VAR PERP EUR-31/12/99																	
USQ653508C80					M USD	88.7518	750,000.			% 31/03/26	90.561		575,953.31	13,534.19	4,780.94	594,268.44	1.64
NATIONAL VAR 2037 EVA-12/01/37																	
XS1071551474					M USD	106.52	400,000.			% 31/03/26	102.935		366,092.22	-8,741.07	26,059.47	383,410.62	1.06
DEUTS BANK TF7V PER EUR-31/12/99																	
XS1751476679					M USD	99.326	400,000.			% 31/03/26	98.873		169,592.35	2,032.37	1,712.66	173,337.38	0.48
LA MONDALE VAR 2048 EUR-18/01/48																	
XS237291963					M USD	95.273	400,000.			% 31/03/26	92.819		324,789.71	-2,557.46	578.61	322,810.86	0.89
SMBK VAR PERP EUR-31/12/99																	
XS2930103580					M USD	104.	200,000.			% 31/03/26	101.309		178,051.70	-2,198.55	4,816.87	180,670.02	0.50
SKANDIA VAR PERP EUR-31/12/99																	
XS3203997005					M USD	99.6833	600,000.			% 31/03/26	90.077		515,018.99	-45,949.39	16,875.33	485,944.93	1.34
SOFTBANK VAR 2061 EUR-29/04/61																	

Stock : Stock adm principal au 31/03/26
 PORTEFEUILLE : OP7439 OFI INVEST SUB DEBT OPPORTUNITIES

Devise de fixing : WAC WAC Closing (EUR)
 Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifié, trame : Devise cotation/Tri comptable(4) --> GLOBALE , Tris : BVAL)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	← PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille PLUS OU MOINS VAL	COURON COURU TOTA	VALEUR BOURSIERE	PRCT ACT NET
Autres disponibles													
						CUMUL (EUR)			59,596.07	-282.25	0.00	59,313.82	0.16
						CUMUL (EUR)			8,567.21	-160.26	0.00	8,406.95	0.02
						CUMUL (EUR)			5,793,854.72	-77,969.52	97,003.41	5,812,888.61	16.02
Tresorerie													
DOLLAR DES ETATS- UNIS													
						(EUR)			36,621,644.90	-930,325.93	583,432.80	36,274,751.77	100.00
PORTEFEUILLE : OFI INVEST SUB DEBT OPPORTUNITIES (OP7439)													

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 31/03/26
 PORTEFEUILLE : OP7439 OFI INVEST SUB DEBT OPPORTUNITIES

VL VALIDEE

Devise de fixing : WMC WM Closing (EUR)
 Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifié, trame : Devise cotation/Tri comptable(4) --> GLOBALE , Tris : BVAL)

Portefeuille titres : 33,915,669.72 Coupons et dividendes a recevoir : 23,875.

Frais de gestion du jour

PrComGestFin : 103.9 EUR
 PrComGestFin : 338.16 EUR

Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
I FR0014002826 PARTS I	EUR	5,417,753.78	5,309.	1,020.48	14.935434127885			1,020.48	1,020.48
XI FR0014002834 PARTS XXL	EUR	30,856,997.99	30,201.	1,021.72	85.064565872115			1,021.72	1,021.72

Actif net total en EUR : 36,274,751.77

Vl theorique

Part	Devise	Actif theorique	Valeur liquidative theorique
I FR0014002826 PARTS I	EUR	5,417,753.78	1,020.48
XI FR0014002834 PARTS XXL	EUR	30,856,997.99	1,021.72

Actif theorique total en EUR : 36,274,751.77 (Sens collecte : EQU)