AFER INFLATION MONDE

ATTESTATION DU COMMISSAIRE AUX COMPTES
Composition de l'actif au 30 juin 2026

ATTESTATION DU COMMISSAIRE AUX COMPTES
Composition de l'actif au 30 juin 2026

AFER INFLATION MONDE
OPCVM CONSTITUE SOUS FORME DE FONDS COMMUN DE PLACEMENT
Régi par le Code monétaire et financier

Société de gestion
OFI INVEST ASSET MANAGEMENT
127-129, quai du Président Roosevelt
92130 Issy-les-Moulineaux

En notre qualité de commissaire aux comptes de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement AFER INFLATION MONDE, et en application des dispositions de l'article L.214-17 du Code monétaire et financier et de l'article 411-125 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. Il nous appartient de nous prononcer sur la cohérence des informations contenues dans la composition de l'actif avec la connaissance que nous avons de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement 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 de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

En application de la loi, nous vous signalons que nous n'avons pas été en mesure d'émettre la présente attestation dans les délais réglementaires compte tenu de la réception tardive de certains documents nécessaires à la finalisation de nos travaux.

Neuilly sur Seine, date de la signature électronique

Document authentifié par signature électronique

Le commissaire aux comptes
PricewaterhouseCoopers Audit

Raphaëlle Alezra-Cabessa



2026.11.02 09:48:09 +01:00

PricewaterhouseCoopers Audit, SAS, 63, rue de Villiers 92208 Neuilly-sur-Seine Cedex
Téléphone : +33 (0)1 56 57 58 59

Société d'expertise comptable inscrite au tableau de l'ordre de Paris - Ile de France. Société de commissariat aux comptes membre de la compagnie régionale de Versailles et du Centre. Société par Actions Simplifiée au capital de 2 510 460 €. Siège social : 63 rue de Villiers 92200 Neuilly-sur-Seine. RCS Nanterre 672 006 483. TVA n° FR 76 672 006 483. Siret 672 006 483 00362. Code APE 6920 Z. Bureaux : Bordeaux, Lille, Lyon, Marseille, Metz, Nantes, Neuilly-Sur-Seine, Rennes, Rouen, Strasbourg, Toulouse, Montpellier

www.pwc.fr

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 193934 AFER INFLATION MONDE VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P.R.U EN DEVISE	DATE	COURS	I	<---------- Devise du portefeuille			----------> PRCT
	VAL/LIGNE	EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR. COURS	COTA	VALEUR	F	PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL ACT NET

I -OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES

AUTRES OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE

OBLIGATIONS A TAUX FIXE NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE

DEVISE VALEUR : EUR EURO

EU000A3K4EY2	EURO UN 3.375 10-54	(366) 051054	8,689,310.	M	EUR	91.4025	% 30/06/26	89.40403766	6	7,942,247.30	7,985,529.16	216,935.17	43,281.86 1.38
EU000A4EG039	EURO UN 4.0 10-55	(366) 121055	25,136,935.	M	EUR	99.6765	% 30/06/26	99.63542158	6	25,055,608.90	25,841,408.88	796,117.72	785,799.98 4.46
FR0014015MU5	FRAN GO 4.1 05-46	(366) 250546	30,250,000.	M	EUR	100.5752	% 30/06/26	98.7595	4	30,423,995.30	30,003,870.67	129,121.92	-420,124.63 5.18
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO													
							CUMUL (EUR)			63,421,851.50	63,830,808.71	1,142,174.81	408,957.21 11.02

DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING

GB00BMF9LG83	UNIT KI 4.5 06-28	(UST) 070628	7,000,000.	M	GBP	101.206	% 30/06/26	100.6345	4	8,148,162.63	8,201,846.69	23,979.27	53,684.06 1.42

DEVISE VALEUR : JPY YEN

JP1300831Q70	JAPA 30 2.2 06-54	(JAP) 200654	4,695,700,000.	M	JPY	93.4896	% 30/06/26	71.025	4	27,098,240.40	17,965,384.02	16,754.92	-9,132,856.38 3.10

DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

US912828ZE35	UNIT ST 0.625 03-27	(366) 310327	1,000,000.	M	USD	100.9877	% 30/06/26	97.537109	4	892,314.23	854,511.99	1,392.87	-37,802.24 0.15
US91282CHJ36	UNIT ST 3.75 06-30	(UST) 300630	6,783,900.	M	USD	98.0291	% 30/06/26	98.308594	4	6,114,427.91	5,833,856.38	604.64	-280,571.53 1.01
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US													
							CUMUL (EUR)			7,006,742.14	6,688,368.37	1,997.51	-318,373.77 1.15

OBLIGATIONS INDEXEES

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FR0013209871	FRAN GO 0.1 07-47	(366) 250747	1,847,411.	M	EUR	84.554	% 30/06/26	66.859	4	1,562,060.81	1,626,141.28	2,275.74	64,080.47 0.28
FR0013327491	FRAN GO 0.1 07-36	(366) 250736	15,904,241.	M	EUR	111.9715	% 30/06/26	86.158	4	17,808,215.70	17,772,897.99	19,307.40	-35,317.71 3.07
FR0013524014	FRAN GO 0.1 03-36	(366) 010336	14,358,671.	M	EUR	98.2004	% 30/06/26	84.1635	4	14,100,276.74	14,187,990.40	5,678.52	87,713.66 2.45
FR0014003N51	FRAN GO 0.1 03-32	(366) 010332	40,080,000.	M	EUR	107.5704	% 30/06/26	91.5555	4	43,114,204.06	43,204,599.66	15,896.37	90,395.60 7.46
FR001400AQH0	FRAN GO 0.1 07-38	(366) 250738	10,226,079.	M	EUR	98.3871	% 30/06/26	82.1005	4	10,061,145.50	10,376,609.54	11,828.99	315,464.04 1.79
FR0011982776	FRAN GO 0.7 07-30	(366) 250730	36,850,000.	M	EUR	128.2214	% 30/06/26	99.1795	4	47,249,589.79	48,596,144.69	319,262.99	1,346,554.90 8.39
IT0005547812	ITAL BU 2.4 05-39	(UST) 150539	20,000,000.	M	EUR	112.8644	% 30/06/26	104.8395	4	22,572,870.72	22,859,952.65	68,055.03	287,081.93 3.95
ES0000012018	SPAI IL 1.15 11-36	(366) 301136	25,791,000.	M	EUR	101.5601	% 30/06/26	97.6355	4	26,193,374.46	26,976,776.81	185,017.25	783,402.35 4.66
ES0000012M69	SPAI IL 2.05 11-39	(366) 301139	11,220,000.	M	EUR	113.9308	% 30/06/26	105.5145	4	12,783,040.16	13,286,126.15	149,638.00	503,085.99 2.29
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO													
							CUMUL (EUR)			195,444,777.94	198,887,239.17	776,960.29	3,442,461.23 34.33

DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING

GB00BZ13DV40	UNIT KI 0.125 08-48	(UST) 100848	13,910,000.	M	GBP	95.948	% 30/06/26	61.8695	4	15,910,943.17	15,078,334.07	11,856.48	-832,609.10 2.60
GB00BT7HZZ68	UNIT KI 1.125 09-35	(UST) 220935	30,430,000.	M	GBP	100.652	% 30/06/26	95.6125	4	35,744,305.47	35,924,231.53	115,637.50	179,926.06 6.20
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING													
							CUMUL (EUR)			51,655,248.64	51,002,565.60	127,493.98	-652,683.04 8.80

DEVISE VALEUR : JPY YEN

JP1120231J51	JAPA GO 0.1 03-28	(JAP) 100328	133,800,000.	M	JPY	105.8379	% 30/06/26	100.267	4	1,008,062.42	823,804.42	254.29	-184,258.00 0.14

DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

US912828ZZ63	UNIT ST 0.125 07-30	(UST) 150730	10,490,000.	M	USD	114.551	% 30/06/26	93.347656	4	10,769,516.87	11,131,471.83	6,872.25	361,954.96 1.92

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 193934 AFER INFLATION MONDE VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<---------- Devise du portefeuille PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	----------> PRCT PLUS OU MOINS VAL	ACT NET
US91282CGW55 UNIT ST 1.25 04-28	(UST) 150428	101,000,000.	M USD	103.0819	% 30/06/26	98.355469	4	93,130,235.09	96,725,305.91	257,929.85	3,595,070.82	16.70
US91282CNB36 UNIT ST 1.625 04-30	(UST) 150430	94,902,700.	M USD	103.6084	% 30/06/26	98.699219	4	84,736,025.19	86,005,799.66	296,876.17	1,269,774.47	14.85
US91282CLE92 UNIT ST 1.875 07-34	(UST) 150734	8,850,000.	M USD	102.4105	% 30/06/26	98.429688	4	8,077,177.81	8,157,390.98	71,061.52	80,213.17	1.41
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US												
					CUMUL (EUR)			196,712,954.96	202,019,968.38	632,739.79	5,307,013.42	34.87
AUTRES OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE												
					CUMUL (EUR)			550,496,040.63	549,419,985.36	2,722,354.86	-1,076,055.27	94.83

III - TITRES D OPC

OPCVM ET EQUIVALENTS D AUTRES ETATS MEMBRE DE L UE

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FR001400KPZ3 OFI INVEST ESG LIQ I		9,851.	P EUR	1077.0264	M 30/06/26	1077.95	0	10,609,787.02	10,618,885.45	0.00	9,098.43	1.83
FR0012217958 OFI INVEST SOV RF		7,789.	P EUR	644.22	M 29/06/26	648.98	5	5,017,829.58	5,054,905.22	0.00	37,075.64	0.87
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO												
					CUMUL (EUR)			15,627,616.60	15,673,790.67	0.00	46,174.07	2.71

VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHES A TERME

ENGAGEMENTS A TERME FERMES

FUTURES SUR OBLIGATIONS

SOUS-JACENT : BTP10Y6 BTP 10Y 6%

FBOL000001CV EURO BTP 0926	260.	EUR	117.82	M 30/06/26	119.35	4	0.00	397,800.00	0.00	397,800.00	0.07

SOUS-JACENT : CBTFV CBOT US TREASURY NOTES 5 ANS

FBOL000001D0 FV CBOT UST 5 0926	-355.	USD	107.0919	M 30/06/26	107.046875	4	0.00	13,965.71	0.00	13,965.71	0.00

SOUS-JACENT : CBTTY CBOT YST 10 A

FBOL000001CY US 10Y ULT 0926	-375.	USD	111.3047	M 30/06/26	112.46875	4	0.00	-381,810.06	0.00	-381,810.06	-0.07

SOUS-JACENT : EUXDU EUREX EURO SCHATZ

FBOL000001CZ EURO SCHATZ 0926	756.	EUR	105.69	M 30/06/26	105.96	4	0.00	204,120.00	0.00	204,120.00	0.04

SOUS-JACENT : EUXOATA EUREX OAT FRENCH GOV 10Y

FBOL000001CO EURO-OAT 0926	-1,073.	EUR	119.1009	M 30/06/26	119.98	4	0.00	-943,290.00	0.00	-943,290.00	-0.16

SOUS-JACENT : EUXRX EUREX EURO BUND

FBOL000001D1 EURO BUND 0926	-279.	EUR	127.4	M 30/06/26	127.34	4	0.00	16,740.00	0.00	16,740.00	0.00

SOUS-JACENT : EUXUB EUREX EURO BUXL

FBOL000001CK XEUR FGBX BUX 0926	91.	EUR	108.34	M 30/06/26	111.22	4	0.00	262,080.00	0.00	262,080.00	0.05

SOUS-JACENT : LIFG LIFFE LONG GILT FUTURE

FBOL000001CR LONG GILT FUT 0926	133.	GBP	87.76	M 30/06/26	89.21	4	0.00	223,879.73	0.00	223,879.73	0.04

SOUS-JACENT : SFEYM AUST 3YR BOND

FBOL000001DS XSFE YT1 AUST 0926	790.	AUD	95.54	M 30/06/26	95.65	4	0.00	150,407.57	0.00	150,407.57	0.03

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 193934 AFER INFLATION MONDE VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P.R.U EN DEVISE	DATE	COURS	I	<---------- Devise du portefeuille ---------->			PRCT
	VAL/LIGNE	EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR. COURS	COTA	VALEUR	F	PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	ACT NET
FUTURES SUR OBLIGATIONS												
					CUMUL (EUR)			0.00	-56,107.05	0.00	-56,107.05	-0.01
VII - AUTRES ENGAGEMENTS												
SWAPS												
SWAPS DE TAUX												
DATE ECHEANCE : 16/02/27												
SWP034755301 SOFFRATE/0.2616/FIX/	NOL RECU	30,000,000.	USD	0.	30/06/26	101.37655896	H	0.00	493,963.37	132,756.61	361,206.76	0.09
	NOL VERSE	-30,000,000.	USD	0.	30/06/26	100.	H	0.00	-195,800.03	-195,800.03	0.00	-0.03
SWP034755701 FIX/2.0047/SOFFRATE/	NOL RECU	30,000,000.	USD	0.	30/06/26	98.78718686	H	0.00	-122,440.10	195,800.03	-318,240.13	-0.02
	NOL VERSE	-30,000,000.	USD	0.	30/06/26	100.	H	0.00	-123,794.48	-123,794.48	0.00	-0.02
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 16/02/27												
					CUMUL (EUR)			0.00	51,928.76	8,962.13	42,966.63	0.01
DATE ECHEANCE : 06/03/28												
SWP034981002 FIX/3.7148/SONIO/0.0	NOL RECU	53,672,022.	GBP	0.	30/06/26	99.50965549	H	0.00	436,421.33	741,944.68	-305,523.35	0.08
	NOL VERSE	-53,672,022.	GBP	0.	30/06/26	100.	H	0.00	-749,294.63	-749,294.63	0.00	-0.13
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 06/03/28												
					CUMUL (EUR)			0.00	-312,873.30	-7,349.95	-305,523.35	-0.05
DATE ECHEANCE : 17/05/28												
SWP034782101 FIX/3.9738/SOFFRATE/	NOL RECU	146,827,000.	USD	0.	30/06/26	99.96952941		0.00	-39,131.51	0.00	-39,131.51	-0.01
	NOL VERSE	-146,827,000.	USD	0.	30/06/26	100.		0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 17/05/28												
					CUMUL (EUR)			0.00	-39,131.51	0.00	-39,131.51	-0.01
DATE ECHEANCE : 07/06/28												
SWP034906702 FIX/4.0913/SOFFRATE/	NOL RECU	218,270,000.	USD	0.	30/06/26	100.09545426		0.00	182,233.90	0.00	182,233.90	0.03
	NOL VERSE	-218,270,000.	USD	0.	30/06/26	100.		0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 07/06/28												
					CUMUL (EUR)			0.00	182,233.90	0.00	182,233.90	0.03
DATE ECHEANCE : 15/12/31												
SWP034796501 FIX/2.6448/SOFFRATE/	NOL RECU	12,000,000.	USD	0.	30/06/26	102.13578658	H	0.00	1,558,165.21	1,333,994.49	224,170.72	0.27
	NOL VERSE	-12,000,000.	USD	0.	30/06/26	100.	H	0.00	-2,198,791.24	-2,198,791.24	0.00	-0.38
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 15/12/31												
					CUMUL (EUR)			0.00	-640,626.03	-864,796.75	224,170.72	-0.11
DATE ECHEANCE : 16/12/31												
SWP034755201 SOFFRATE/0.2616/FIX/	NOL RECU	12,000,000.	USD	0.	30/06/26	112.801436	H	0.00	1,360,624.53	16,994.40	1,343,630.13	0.23
	NOL VERSE	-12,000,000.	USD	0.	30/06/26	100.	H	0.00	-6,781.68	-6,781.68	0.00	0.00
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 16/12/31												
					CUMUL (EUR)			0.00	1,353,842.85	10,212.72	1,343,630.13	0.23
DATE ECHEANCE : 03/12/35												
SWP034814802 SOFFRATE/0.0/FIX/3.9	NOL RECU	13,869,000.	USD	0.	30/06/26	100.44041062		0.00	53,424.78	0.00	53,424.78	0.01

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 193934 AFER INFLATION MONDE VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<---------- Devise du portefeuille ----------> PRIX REVIENT TOTA	 VALEUR BOURSIERE	 COUPON COURU TOTA	 PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
	NOL VERSE	-13,869,000.	USD	0.	30/06/26	100.		0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 03/12/35												
					CUMUL (EUR)			0.00	53,424.78	0.00	53,424.78	0.01
DATE ECHEANCE : 28/01/36												
SWP034755501 SOFFRATE/0.0/FIX/4.2	NOL RECU	38,906,149.	USD	0.	30/06/26	99.40869678		0.00	-201,218.68	0.00	-201,218.68	-0.03
	NOL VERSE	-38,906,149.	USD	0.	30/06/26	100.		0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 28/01/36												
					CUMUL (EUR)			0.00	-201,218.68	0.00	-201,218.68	-0.03
DATE ECHEANCE : 29/01/36												
SWP034753601 FIX/5.2807/BBSW6R/0.	NOL RECU	54,123,718.	AUD	0.	30/06/26	100.96300381		0.00	315,839.09	0.00	315,839.09	0.05
	NOL VERSE	-54,123,718.	AUD	0.	30/06/26	100.		0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 29/01/36												
					CUMUL (EUR)			0.00	315,839.09	0.00	315,839.09	0.05
DATE ECHEANCE : 29/02/36												
SWP034753701 FIX/5.0262/BBSW6R/0.	NOL RECU	22,449,421.	AUD	0.	30/06/26	100.00205212		0.00	279.16	0.00	279.16	0.00
	NOL VERSE	-22,449,421.	AUD	0.	30/06/26	100.		0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 29/02/36												
					CUMUL (EUR)			0.00	279.16	0.00	279.16	
DATE ECHEANCE : 13/03/36												
SWP034753801 FIX/2.9485/E6R/0.0	NOL RECU	27,045,396.	EUR	0.	30/06/26	100.40962165	H	0.00	347,798.76	237,014.96	110,783.80	0.06
	NOL VERSE	-27,045,396.	EUR	0.	30/06/26	100.	H	0.00	-177,941.43	-177,941.43	0.00	-0.03
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 13/03/36												
					CUMUL (EUR)			0.00	169,857.33	59,073.53	110,783.80	0.03
DATE ECHEANCE : 28/04/36												
SWP034753901 FIX/3.069/E6R/0.0	NOL RECU	20,706,000.	EUR	0.	30/06/26	101.35582072	H	0.00	390,177.80	109,441.56	280,736.24	0.07
	NOL VERSE	-20,706,000.	EUR	0.	30/06/26	100.	H	0.00	-89,103.09	-89,103.09	0.00	-0.02
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 28/04/36												
					CUMUL (EUR)			0.00	301,074.71	20,338.47	280,736.24	0.05
DATE ECHEANCE : 23/06/36												
SWP035009002 SONIO/0.0/FIX/4.37	NOL RECU	21,787,000.	GBP	0.	30/06/26	99.72966319	H	0.00	-47,695.88	20,679.19	-68,375.07	-0.01
	NOL VERSE	-21,787,000.	GBP	0.	30/06/26	100.	H	0.00	-24,225.41	-24,225.41	0.00	0.00
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 23/06/36												
					CUMUL (EUR)			0.00	-71,921.29	-3,546.22	-68,375.07	-0.01
DATE ECHEANCE : 13/02/46												
SWP034754401 E6R/0.0/FIX/3.1482	NOL RECU	11,080,000.	EUR	0.	30/06/26	99.67981489	H	0.00	-168,222.11	-132,745.60	-35,476.51	-0.03
	NOL VERSE	-11,080,000.	EUR	0.	30/06/26	100.	H	0.00	88,884.99	88,884.99	0.00	0.02
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 13/02/46												
					CUMUL (EUR)			0.00	-79,337.12	-43,860.61	-35,476.51	-0.01
DATE ECHEANCE : 02/03/46												
SWP034754601 E6R/0.0/FIX/3.0267	NOL RECU	3,360,233.	EUR	0.	30/06/26	101.45205525	H	0.00	15,456.07	-33,336.37	48,792.44	0.00

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 193934 AFER INFLATION MONDE VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<---------- Devise du portefeuille PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	----------> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
	NOL VERSE	-3,360,233.	EUR	0.	30/06/26	100.	H	0.00	23,902.46	23,902.46	0.00	0.00
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 02/03/46												
					CUMUL (EUR)			0.00	39,358.53	-9,433.91	48,792.44	0.01
DATE ECHEANCE : 05/03/46												
SWP034754801 E6R/0.0/FIX/3.0527	NOL RECU	13,550,000.	EUR	0.	30/06/26	101.05701904	H	0.00	11,090.81	-132,135.27	143,226.08	0.00
	NOL VERSE	-13,550,000.	EUR	0.	30/06/26	100.	H	0.00	93,359.50	93,359.50	0.00	0.02
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 05/03/46												
					CUMUL (EUR)			0.00	104,450.31	-38,775.77	143,226.08	0.02
DATE ECHEANCE : 30/08/55												
SWP034754101 E6R/0.0/FIX/2.9282	NOL RECU	8,940,000.	EUR	0.	30/06/26	102.99333445	H	0.00	333,471.04	65,866.94	267,604.10	0.06
	NOL VERSE	-8,940,000.	EUR	0.	30/06/26	100.	H	0.00	-220,332.41	-220,332.41	0.00	-0.04
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 30/08/55												
					CUMUL (EUR)			0.00	113,138.63	-154,465.47	267,604.10	0.02
DATE ECHEANCE : 02/12/55												
SWP034754001 FIX/3.0823/E6R/0.0	NOL RECU	8,940,000.	EUR	0.	30/06/26	99.93821711	H	0.00	154,453.12	159,976.51	-5,523.39	0.03
	NOL VERSE	-8,940,000.	EUR	0.	30/06/26	100.	H	0.00	-18,342.65	-18,342.65	0.00	0.00
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 02/12/55												
					CUMUL (EUR)			0.00	136,110.47	141,633.86	-5,523.39	0.02
DATE ECHEANCE : 06/12/55												
SWP034755101 E6R/0.0/FIX/3.1227	NOL RECU	8,700,000.	EUR	0.	30/06/26	99.26982068	H	0.00	-46,952.10	16,573.50	-63,525.60	-0.01
	NOL VERSE	-8,700,000.	EUR	0.	30/06/26	100.	H	0.00	-156,213.07	-156,213.07	0.00	-0.03
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 06/12/55												
					CUMUL (EUR)			0.00	-203,165.17	-139,639.57	-63,525.60	-0.04
DATE ECHEANCE : 21/01/56												
SWP034754201 E6R/0.0/FIX/3.1092	NOL RECU	8,579,970.	EUR	0.	30/06/26	99.50053216	H	0.00	39,836.46	82,690.65	-42,854.19	0.01
	NOL VERSE	-8,579,970.	EUR	0.	30/06/26	100.	H	0.00	-118,563.75	-118,563.75	0.00	-0.02
SWP034754301 E6R/0.0/FIX/3.1097	NOL RECU	8,580,000.	EUR	0.	30/06/26	99.49077062	H	0.00	38,999.06	82,690.94	-43,691.88	0.01
	NOL VERSE	-8,580,000.	EUR	0.	30/06/26	100.	H	0.00	-118,583.23	-118,583.23	0.00	-0.02
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 21/01/56												
					CUMUL (EUR)			0.00	-158,311.46	-71,765.39	-86,546.07	-0.03
DATE ECHEANCE : 02/03/56												
SWP034773702 E6R/0.0/FIX/3.0162	NOL RECU	6,755,757.	EUR	0.	30/06/26	101.00402367	H	0.00	1,039.06	-66,790.34	67,829.40	0.00
	NOL VERSE	-6,755,757.	EUR	0.	30/06/26	100.	H	0.00	48,055.95	48,055.95	0.00	0.01
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 02/03/56												
					CUMUL (EUR)			0.00	49,095.01	-18,734.39	67,829.40	0.01
DATE ECHEANCE : 13/03/56												
SWP034754901 E6R/0.0/FIX/3.0822	NOL RECU	11,898,190.	EUR	0.	30/06/26	99.69678942	H	0.00	-145,075.69	-108,999.12	-36,076.57	-0.03
	NOL VERSE	-11,898,190.	EUR	0.	30/06/26	100.	H	0.00	78,282.49	78,282.49	0.00	0.01
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 13/03/56												
					CUMUL (EUR)			0.00	-66,793.20	-30,716.63	-36,076.57	-0.01

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 193934 AFER INFLATION MONDE VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	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 VALEUR BOURSIERE	 COUPON COURU TOTA	----------> PRCT PLUS OU MOINS VAL	 ACT NET
DATE ECHEANCE : 28/04/56												
SWP034755001 E6R/0.0/FIX/3.1492	NOL RECU	9,126,000.	EUR	0.	30/06/26	98.40235086	H	0.00	-195,297.44	-49,495.98	-145,801.46	-0.03
	NOL VERSE	-9,126,000.	EUR	0.	30/06/26	100.	H	0.00	39,271.46	39,271.46	0.00	0.01
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 28/04/56												
					CUMUL (EUR)			0.00	-156,025.98	-10,224.52	-145,801.46	-0.03
DATE ECHEANCE : 23/06/56												
SWP035008502 FIX/4.7948/SONIO/0.0	NOL RECU	11,219,000.	GBP	0.	30/06/26	100.35836705	H	0.00	60,361.53	13,687.28	46,674.25	0.01
	NOL VERSE	-11,219,000.	GBP	0.	30/06/26	100.	H	0.00	-10,648.54	-10,648.54	0.00	0.00
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 23/06/56												
					CUMUL (EUR)			0.00	49,712.99	3,038.74	46,674.25	0.01
SWAPS DE TAUX												
					CUMUL (EUR)			0.00	990,942.78	-1,150,049.73	2,140,992.51	0.17
DERIVES DE CREDIT												
CREDIT DEFAULT SWAP (CDS)												
DATE ECHEANCE : 20/06/31												
CDS033856001 ITRAXX EUR XOVER S45	APROT 20/06/31	-35,000,000.	EUR	9.1739 %	30/06/26	-10.9742	H	-3,210,877.93	-3,889,581.21	-48,611.21	-678,703.28	-0.67
VII - AUTRES ENGAGEMENTS												
					CUMUL (EUR)			-3,210,877.93	-2,898,638.43	-1,198,660.94	1,462,289.23	-0.50
IX - TRESORERIE												
DETTES ET CREANCES												
COLLATERAL CASH SUR DERIVES LISTES												
DEVISE VALEUR : AUD DOLLAR AUSTRALIEN												
DGMBNAUD Depot garantie BNPP		-457,989.44	AUD	0.60907415	30/06/26	0.60596879		-278,949.53	-277,527.31	0.00	1,422.22	-0.05
DGMCIAUD Dépôt gar. CACEIS BK		832,660.	AUD	0.59736813	30/06/26	0.60596879		497,404.55	504,565.97	0.00	7,161.42	0.09
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : AUD DOLLAR AUSTRALIEN												
					CUMUL (EUR)			218,455.02	227,038.66	0.00	8,583.64	0.04
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
DGMBNEUR Depot garantie BNPP		3,542,597.67	EUR	1.	30/06/26	1.		3,542,597.67	3,542,597.67	0.00	0.00	0.61
DGMCIEUR Dépôt gar. CACEIS BK		1,987,512.2	EUR	1.	30/06/26	1.		1,987,512.20	1,987,512.20	0.00	0.00	0.34
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO												
					CUMUL (EUR)			5,530,109.87	5,530,109.87	0.00	0.00	0.95
DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING												
DGMBNGBP Depot garantie BNPP		275,814.86	GBP	1.15464	30/06/26	1.16090086		318,466.87	320,193.71	0.00	1,726.84	0.06
DGMCIGBP Dépôt gar. CACEIS BK		380,380.	GBP	1.14670845	30/06/26	1.16090086		436,184.96	441,583.47	0.00	5,398.51	0.08
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING												
					CUMUL (EUR)			754,651.83	761,777.18	0.00	7,125.35	0.13
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US												
DGMBNUSD Depot garantie BNPP		-910,748.03	USD	0.8674755	30/06/26	0.87466107		-790,051.60	-796,595.85	0.00	-6,544.25	-0.14
DGMCIUSD Dépôt gar. CACEIS BK		1,400,000.	USD	0.86204642	30/06/26	0.87466107		1,206,864.99	1,224,525.50	0.00	17,660.51	0.21

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 193934 AFER INFLATION MONDE VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<---------- Devise du portefeuille PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	----------> PRCT PLUS OU MOINS VAL	ACT NET
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US												
					CUMUL (EUR)			416,813.39	427,929.65	0.00	11,116.26	0.07
COLLATERAL CASH SUR DERIVES LISTES												
					CUMUL (EUR)			6,920,030.11	6,946,855.36	0.00	26,825.25	1.20
COLLATERAL CASH SUR DERIVES OTC CLEARED												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
I0000410	IM BNP CLEARING	6,676,499.53	EUR	1.	30/06/26	1.		6,676,499.53	6,676,499.53	0.00	0.00	1.15
COLLATERAL CASH OTC												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
CLRCAIEUR	Collatéral esp Recu	7,380,000.	EUR	1.	30/06/26	1.		7,380,000.00	7,380,000.00	0.00	0.00	1.27
CLRSGPEUR	Collatéral esp Recu	-800,000.	EUR	1.	30/06/26	1.		-800,000.00	-800,000.00	0.00	0.00	-0.14
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO												
					CUMUL (EUR)			6,580,000.00	6,580,000.00	0.00	0.00	1.14
APPELS DE MARGE												
DEVISE VALEUR : AUD DOLLAR AUSTRALIEN												
MARCIAUD	Appel Marge CACEIS	-248,210.1	AUD	0.60794194	30/06/26	0.60596879		-150,897.33	-150,407.57	0.00	489.76	-0.03
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
MARCIEUR	Appel Marge CACEIS	62,550.	EUR	1.	30/06/26	1.		62,550.00	62,550.00	0.00	0.00	0.01
DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING												
MARCIGBP	Appel Marge CACEIS	-192,850.	GBP	1.15866347	30/06/26	1.16090086		-223,448.25	-223,879.73	0.00	-431.48	-0.04
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US												
MARCIUSD	Appel Marge CACEIS	420,556.44	USD	0.87843596	30/06/26	0.87466107		369,431.90	367,844.35	0.00	-1,587.55	0.06
APPELS DE MARGE												
					CUMUL (EUR)			57,636.32	56,107.05	0.00	-1,529.27	0.01
FRAIS DE GESTION												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
FGDEPEUR	Prov com depositaire	-897.25	EUR	1.	30/06/26	1.		-897.25	-897.25	0.00	0.00	0.00
FGPVAEUR	Frais de Gest. Admi	-2,445.68	EUR	1.	30/06/26	1.		-2,445.68	-2,445.68	0.00	0.00	0.00
FGPVFD1EUR	Frais de Gest. Fixe	-473,721.48	EUR	1.	30/06/26	1.		-473,721.48	-473,721.48	0.00	0.00	-0.08
FGPVFD2EUR	Frais de Gest. Fixe	-1,163.15	EUR	1.	30/06/26	1.		-1,163.15	-1,163.15	0.00	0.00	0.00
FGPVHEUR	Frais de Gest. H.C.C	-301.37	EUR	1.	30/06/26	1.		-301.37	-301.37	0.00	0.00	0.00
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO												
					CUMUL (EUR)			-478,528.93	-478,528.93	0.00	0.00	-0.08

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 193934 AFER INFLATION MONDE VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<---------- Devise du portefeuille PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	----------> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
AUTRES DETTES ET CREANCES												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
CAPEPEUR	Chges à payer ex.pre	29,003.14	EUR	1.	30/06/26	1.		29,003.14	29,003.14	0.00	0.00	0.01
FRTOEUR	Frais RTO	-20,937.52	EUR	1.	30/06/26	1.		-20,937.52	-20,937.52	0.00	0.00	0.00
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO												
					CUMUL (EUR)			8,065.62	8,065.62	0.00	0.00	
DETTES ET CREANCES												
					CUMUL (EUR)			19,763,702.65	19,788,998.63	0.00	25,295.98	3.42
DISPONIBILITES												
AVOIRS												
DEVISE VALEUR : AUD DOLLAR AUSTRALIEN												
BQCIAUD	CACEIS Bank	2,305,356.72	AUD	0.61117585	30/06/26	0.60596879		1,408,978.36	1,396,974.23	0.00	-12,004.13	0.24
DEVISE VALEUR : CAD DOLLAR CANADIEN												
BQCICAD	CACEIS Bank	85,092.92	CAD	0.6126901	30/06/26	0.61650381		52,135.59	52,460.11	0.00	324.52	0.01
DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE												
BQCICHF	CACEIS Bank	12,780.66	CHF	1.02495568	30/06/26	1.08430469		13,099.61	13,858.13	0.00	758.52	0.00
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
BQCIEUR	CACEIS Bank	246,082.	EUR	1.	30/06/26	1.		246,082.00	246,082.00	0.00	0.00	0.04
DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING												
BQCIGBP	CACEIS Bank	24,720.73	GBP	1.15929505	30/06/26	1.16090086		28,658.62	28,698.32	0.00	39.70	0.00
DEVISE VALEUR : HKD DOLLAR DE HONG-KONG												
BQCIHKD	CACEIS Bank	-5,914.67	HKD	0.1085572	30/06/26	0.11153494		-642.08	-659.69	0.00	-17.61	0.00
DEVISE VALEUR : JPY YEN												
BQCIJPY	CACEIS Bank	203,957,652.	JPY	0.00539056	30/06/26	0.0053817		1,099,445.21	1,097,639.43	0.00	-1,805.78	0.19
DEVISE VALEUR : NOK COURONNE NORVEGIENNE												
BQCINOK	CACEIS Bank	1,931,075.36	NOK	0.08942715	30/06/26	0.08838998		172,690.56	170,687.71	0.00	-2,002.85	0.03
DEVISE VALEUR : NZD DOLLAR NEO ZELANDAIS												
BQCINZD	CACEIS Bank	96,616.63	NZD	0.5620697	30/06/26	0.49754957		54,305.28	48,071.56	0.00	-6,233.72	0.01
DEVISE VALEUR : SEK COURONNE SUEDOISE												
BQCISEK	CACEIS Bank	79,350.01	SEK	0.09536218	30/06/26	0.09037506		7,566.99	7,171.26	0.00	-395.73	0.00
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US												
BQCIUSD	CACEIS Bank	227,903.85	USD	0.87489641	30/06/26	0.87466107		199,392.26	199,338.63	0.00	-53.63	0.03

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 193934 AFER INFLATION MONDE VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<---------- Devise du portefeuille ----------> PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
AVOIRS												
					CUMUL (EUR)			3,281,712.40	3,260,321.69	0.00	-21,390.71	0.56
CHANGE A TERME ET SWAP DE CHANGE												
DATE ECHEANCE : 15/07/26												
ICAT0002DGHJ A/USD/EUR/20260715	RECU 15/07/26	8,815,839.98	USD	0.8527	30/06/26	0.87409343		7,517,331.47	7,705,867.79	0.00	188,536.32	1.33
	VERSE 15/07/26	-7,517,331.47	EUR	1.	30/06/26	1.		-7,517,331.47	-7,517,331.47	0.00	0.00	-1.30
ICAT0002DRFM V/GBP/EUR/20260715	RECU 15/07/26	1,013,828.49	EUR	1.	30/06/26	1.		1,013,828.49	1,013,828.49	0.00	0.00	0.17
	VERSE 15/07/26	-878,195.47	GBP	1.1544	30/06/26	1.16024765		-1,013,828.49	-1,018,924.23	0.00	-5,095.74	-0.18
ICAT0002DRRE A/USD/EUR/20260715	RECU 15/07/26	66,350,717.	USD	0.8518	30/06/26	0.87409343		56,516,188.16	57,996,725.70	0.00	1,480,537.54	10.01
	VERSE 15/07/26	-56,516,188.16	EUR	1.	30/06/26	1.		-56,516,188.16	-56,516,188.16	0.00	0.00	-9.76
ICAT0002DRRU V/GBP/EUR/20260715	RECU 15/07/26	381,186.72	EUR	1.	30/06/26	1.		381,186.72	381,186.72	0.00	0.00	0.07
	VERSE 15/07/26	-331,122.	GBP	1.1512	30/06/26	1.16024765		-381,186.72	-384,183.52	0.00	-2,996.80	-0.07
ICAT0002DRSF A/USD/EUR/20260715	RECU 15/07/26	4,576,082.	USD	0.8489	30/06/26	0.87409343		3,884,481.20	3,999,923.20	0.00	115,442.00	0.69
	VERSE 15/07/26	-3,884,481.2	EUR	1.	30/06/26	1.		-3,884,481.20	-3,884,481.20	0.00	0.00	-0.67
ICAT0002GLS2 A/EUR/GBP/20260715	RECU 15/07/26	15,671,232.04	EUR	0.868	30/06/26	0.86188496		15,671,232.04	15,680,054.86	0.00	8,822.82	2.71
	VERSE 15/07/26	-13,602,935.	GBP	1.	30/06/26	1.		-15,671,232.04	-15,791,658.93	0.00	-120,426.89	-2.73
ICAT0002GTVN A/EUR/USD/20260715	RECU 15/07/26	23,567,525.59	EUR	1.1427	30/06/26	1.14390917		23,567,525.59	23,580,082.74	0.00	12,557.15	4.07
	VERSE 15/07/26	-26,931,365.65	USD	1.	30/06/26	1.		-23,567,525.59	-23,555,817.06	0.00	11,708.53	-4.07
ICAT0002VBN V/JPY/EUR/20260715	RECU 15/07/26	21,184,172.29	EUR	1.	30/06/26	1.		21,184,172.29	21,184,172.29	0.00	0.00	3.66
	VERSE 15/07/26	-3,939,414,187.	JPY	0.0054	30/06/26	0.00538531		-21,184,172.29	-21,214,973.31	0.00	-30,801.02	-3.66
ICAT000AJCM V/GBP/EUR/20260715	RECU 15/07/26	40,616,702.43	EUR	1.	30/06/26	1.		40,616,702.43	40,616,702.43	0.00	0.00	7.01
	VERSE 15/07/26	-35,512,917.27	GBP	1.1437	30/06/26	1.16024765		-40,616,702.43	-41,203,778.64	0.00	-587,076.21	-7.11
ICAT000QSCB V/AUD/EUR/20260715	RECU 15/07/26	925,203.	EUR	1.	30/06/26	1.		925,203.00	925,203.00	0.00	0.00	0.16
	VERSE 15/07/26	-1,541,502.	AUD	0.6002	30/06/26	0.60549115		-925,203.00	-933,365.81	0.00	-8,162.81	-0.16
ICAT000ZSCG V/USD/EUR/20260715	RECU 15/07/26	254,453,759.77	EUR	1.	30/06/26	1.		254,453,759.77	254,453,759.77	0.00	0.00	43.92
	VERSE 15/07/26	-298,707,874.21	USD	0.8518	30/06/26	0.87419528		-254,453,759.77	-261,129,014.78	0.00	-6,675,255.01	-45.07
ICAT00DFDDF A/USD/EUR/20260715	RECU 15/07/26	11,751,004.	USD	0.8506	30/06/26	0.87409343		9,995,359.15	10,271,475.37	0.00	276,116.22	1.77
	VERSE 15/07/26	-9,995,359.15	EUR	1.	30/06/26	1.		-9,995,359.15	-9,995,359.15	0.00	0.00	-1.73
ICAT00DFFCP V/USD/EUR/20260715	RECU 15/07/26	13,978,743.2	EUR	1.	30/06/26	1.		13,978,743.20	13,978,743.20	0.00	0.00	2.41
	VERSE 15/07/26	-16,402,969.	USD	0.8522	30/06/26	0.87419528		-13,978,743.20	-14,339,398.14	0.00	-360,654.94	-2.48
ICAT00DFVGH V/USD/EUR/20260715	RECU 15/07/26	5,537,013.19	EUR	1.	30/06/26	1.		5,537,013.19	5,537,013.19	0.00	0.00	0.96
	VERSE 15/07/26	-6,500,000.	USD	0.8518	30/06/26	0.87419528		-5,537,013.19	-5,682,269.34	0.00	-145,256.15	-0.98
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 15/07/26												
					CUMUL (EUR)			0.00	-5,842,004.99	0.00	-5,842,004.99	-1.01
DISPONIBILITES												
					CUMUL (EUR)			3,281,712.40	-2,581,683.30	0.00	-5,863,395.70	-0.45
IX - TRESORERIE												
					CUMUL (EUR)			23,045,415.05	17,207,315.33	0.00	-5,838,099.72	2.97
PORTEFEUILLE : AFER INFLATION MONDE (193934)												
					(EUR)			585,958,194.35	579,346,345.88	1,523,693.92	-5,461,798.74	100.00

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 193934 AFER INFLATION MONDE VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVALO4)

Portefeuille titres : 556,297,025.56

Frais de gestion du jour

Frais de Gest. Admi :	24.2	EUR
Frais de Gest. Admi :	49.08	EUR
Frais de Gest. H.C.C :	18.91	EUR
Prov com depositaire :	1.54	EUR
Prov com depositaire :	66.9	EUR
Frais de Gest. Fixe :	15,284.07	EUR
Frais de Gest. Fixe :	39.86	EUR

Frais de gestion charge Entreprise

Frais maximum notice :	15,284.07	EUR
Frais maximum notice :	47.83	EUR

Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
D1 FR0013498532 AFER INFLATI MONDE A	EUR	573,365,248.83	4,957,556.	115.65	98.967633304325			120.27	115.65
D2 FR001400RY05 AFER GEN INF MONDE	EUR	5,981,097.05	57,051.	104.83	1.032366695675			109.02	104.83

Actif net total en EUR : 579,346,345.88

Precedente VL en date du 29/06/26 :

D1	AFER INFLATI MONDE A	Prec. VL :	115.81	(EUR)	Variation : -0.138%
D2	AFER GEN INF MONDE	Prec. VL :	104.98	(EUR)	Variation : -0.143%

VL theorique

Part	Devise	Actif theorique	Valeur liquidative theorique
D1 FR0013498532 AFER INFLATI MONDE A	EUR	573,365,248.83	115.65
D2 FR001400RY05 AFER GEN INF MONDE	EUR	5,981,097.05	104.83

Actif theorique total en EUR : 579,346,345.88 (Sens collecte : EQU)

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/26 Devise de fixing : FXR Devises Reuters
PORTEFEUILLE : 193934 AFER INFLATION MONDE VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVALO4)

COURS DES DEVISES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente		variation
Cours AUD en EUR :	0.6059687926	cotation : 30/06/26	0.		0.602373351	cotation : 29/06/26	0.59688
Cours EUR en AUD :	1.65025	cotation : 30/06/26	0.		1.6601	cotation : 29/06/26	-0.59334
Cours EUR en CAD :	1.62205	cotation : 30/06/26	0.		1.6232	cotation : 29/06/26	-0.07085
Cours EUR en CHF :	0.92225	cotation : 30/06/26	0.		0.9236	cotation : 29/06/26	-0.14617
Cours EUR en GBP :	0.8614	cotation : 30/06/26	0.		0.8623	cotation : 29/06/26	-0.10437
Cours EUR en HKD :	8.9658	cotation : 30/06/26	0.		8.9587	cotation : 29/06/26	0.07925
Cours EUR en JPY :	185.8148	cotation : 30/06/26	0.		184.97025	cotation : 29/06/26	0.45659
Cours EUR en NOK :	11.3135	cotation : 30/06/26	0.		11.3355	cotation : 29/06/26	-0.19408
Cours EUR en NZD :	2.00985	cotation : 30/06/26	0.		2.02365	cotation : 29/06/26	-0.68194
Cours EUR en SEK :	11.065	cotation : 30/06/26	0.		11.11	cotation : 29/06/26	-0.40504
Cours EUR en USD :	1.1433	cotation : 30/06/26	0.		1.14225	cotation : 29/06/26	0.09192
Cours GBP en EUR :	1.1609008591	cotation : 30/06/26	0.		1.1596892033	cotation : 29/06/26	0.10448
Cours JPY en EUR :	0.0053817026	cotation : 30/06/26	0.		0.0054062748	cotation : 29/06/26	-0.45451
Cours USD en EUR :	0.8746610688	cotation : 30/06/26	0.		0.8754650908	cotation : 29/06/26	-0.09184

COURS INVERSES DES DEVISES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente	
Cours EUR en AUD :	1.65025	cotation : 30/06/26	0.		1.6601	cotation : 29/06/26
Cours AUD en EUR :	0.6059687926	cotation : 30/06/26	0.		0.602373351	cotation : 29/06/26
Cours CAD en EUR :	0.6165038069	cotation : 30/06/26	0.		0.6160670281	cotation : 29/06/26
Cours CHF en EUR :	1.0843046896	cotation : 30/06/26	0.		1.0827197921	cotation : 29/06/26
Cours GBP en EUR :	1.1609008591	cotation : 30/06/26	0.		1.1596892033	cotation : 29/06/26
Cours HKD en EUR :	0.1115349439	cotation : 30/06/26	0.		0.1116233382	cotation : 29/06/26
Cours JPY en EUR :	0.0053817026	cotation : 30/06/26	0.		0.0054062748	cotation : 29/06/26
Cours NOK en EUR :	0.0883899766	cotation : 30/06/26	0.		0.0882184288	cotation : 29/06/26
Cours NZD en EUR :	0.4975495684	cotation : 30/06/26	0.		0.4941565982	cotation : 29/06/26
Cours SEK en EUR :	0.0903750565	cotation : 30/06/26	0.		0.0900090009	cotation : 29/06/26
Cours USD en EUR :	0.8746610688	cotation : 30/06/26	0.		0.8754650908	cotation : 29/06/26
Cours EUR en GBP :	0.8614	cotation : 30/06/26	0.		0.8623	cotation : 29/06/26
Cours EUR en JPY :	185.8148014348	cotation : 30/06/26	0.		184.970249755	cotation : 29/06/26
Cours EUR en USD :	1.1433	cotation : 30/06/26	0.		1.14225	cotation : 29/06/26