



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

Fonds Commun de Placement AFER OBLIG MONDE ENTREPRISES

**Attestation du commissaire aux comptes sur la composition de l'actif
au 31 mars 2026**

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

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

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



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

Fonds Commun de Placement AFER OBLIG MONDE ENTREPRISES

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

Attestation du commissaire aux comptes sur la composition de l'actif au 31 mars 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 31 mars 2026 ci-jointe.

Ces informations ont été établies sous la responsabilité de la société de gestion du fonds. Il nous appartient de nous prononcer sur la cohérence des informations contenues dans la composition de l'actif avec la connaissance que nous avons du fonds acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Nous avons mis en œuvre les diligences que nous avons estimé nécessaires au regard de la doctrine professionnelle de la Compagnie nationale des commissaires aux comptes relative à cette mission. Ces diligences, qui ne constituent ni un audit ni un examen limité, ont consisté essentiellement à réaliser des procédures analytiques et des entretiens avec les personnes qui produisent et contrôlent les informations données.

Sur la base de nos travaux, nous n'avons pas d'observation à formuler sur la cohérence des informations figurant dans le document joint avec la connaissance que nous avons du fonds acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Paris La Défense

KPMG S.A.

Séverine Ernest
Associée

Inventaire du portefeuille AFER OBLIG MONDE ENTREPRISES au 31/03/2026

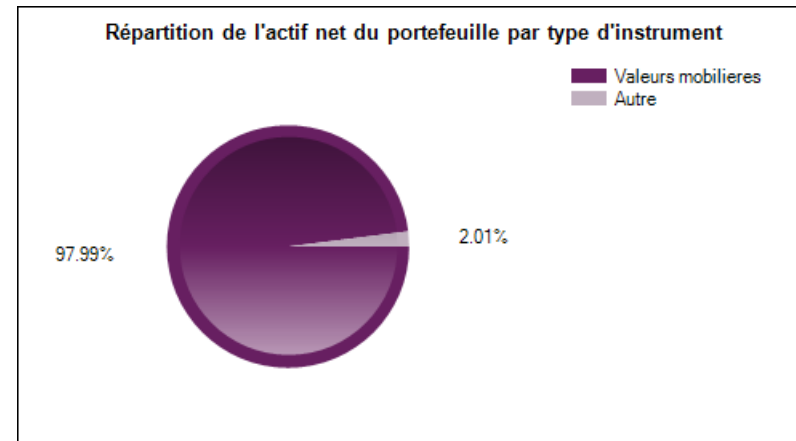
▼ Descriptif du portefeuille

Libellé	Code	Actif net	Dev	Statut VL
AFER OBLIG MONDE ENTREPRISES	FAMA54	487 597 201.08 EUR		OFF

▼ Synthèse

Part	Code ISIN	VL	Actif de la part	Dev	Nombre de parts
AG	FR001400RXY5	103.62	10 331 651.95000	EUR	99 704.00
D	FR0011731710	101.96	476 576 313.98000	EUR	4 673 995.9998
DD	FR001400LOS2	99.54	689 235.15000	EUR	6 924.00

Valeur boursière	Prix de revient	+/- value	Intérêts courus
Valeurs mobilières			
485 240 399.96	471 728 903.34	11 098 920.83	2 412 575.79
Coupons			
100 933.00	100 933.00		
Futures			
-1 298 524.63		-1 298 524.63	
Change a terme			
-3 913 016.25		-3 913 016.25	
Derives de credit			
-2 374 646.20	-2 494 694.32	186 673.12	-66 625.00
Liquidités			
9 842 055.20	9 847 458.39	-5 403.19	
Total			
487 597 201.08	479 182 600.41	6 068 649.88	2 345 950.79



v Détails

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
Valeurs mobilières										
Obligation										
US00287YCA55	ABBVIE INC 4.05% 21/11/2039	5 500 000.000	87.81200	USD	31/03/2026	4 417 404.87	4 261 497.57	69 812.10	-225 719.40	0.87
US01626PAH91	ALIMENTATION COUCHE TARD 3.55% 26/07/2027	2 984 000.000	98.87500	USD	31/03/2026	2 655 931.52	2 577 292.67	16 600.08	-95 238.93	0.53
US02079KBA43	ALPHABET INC 5.45% 15/11/2055	4 500 000.000	96.85500	USD	31/03/2026	3 925 526.11	3 868 474.44	85 732.73	-142 784.40	0.79
US025816DV84	AMERICAN EXPRESS CO VAR 26/07/2028	5 130 000.000	100.89000	USD	31/03/2026	4 695 128.62	4 532 518.48	40 540.52	-203 150.66	0.93
US03027XAX84	AMERICAN TOWER CORP 2.75% 15/01/2027	3 412 000.000	98.76800	USD	31/03/2026	2 989 315.92	2 942 000.28	17 191.95	-64 507.59	0.60
US031162DR88	AMGEN INC 5.25% 02/03/2033	2 380 000.000	102.71000	USD	31/03/2026	2 233 699.35	2 130 327.56	8 735.83	-112 107.62	0.44
US03522AAJ97	ANHEUSER BUSCH CO NBEV 4.9% 01/02/2046	4 500 000.000	90.24800	USD	31/03/2026	3 825 938.62	3 556 596.08	31 895.50	-301 238.04	0.73
US037833EW60	APPLE INC 4.85% 10/05/2053	4 766 000.000	92.06000	USD	31/03/2026	4 313 516.57	3 886 576.76	78 575.02	-505 514.83	0.80
US04636NAL73	ASTRAZENECA FINANCE LLC 4.8% 26/02/2029	4 030 000.000	101.67600	USD	31/03/2026	3 752 338.97	3 572 769.81	16 492.42	-196 061.58	0.73
US00206RMT67	AT&T INC 5.40% 15/02/2034	3 000 000.000	102.39000	USD	31/03/2026	2 791 413.07	2 683 909.04	17 965.63	-125 469.66	0.55
US05964HBD61	BANCO SANTANDER SA 6.35% 14/03/2034	4 400 000.000	105.03500	USD	31/03/2026	4 203 164.01	4 022 508.15	11 451.04	-192 106.90	0.82
US06406RBV87	BANK OF NY MELLON CORP VAR 14/03/2030	2 000 000.000	101.72600	USD	31/03/2026	1 859 638.98	1 769 847.78	4 077.95	-93 869.15	0.36
US06738ECV56	BARCLAYS PLC VAR 10/09/2035	4 600 000.000	99.01200	USD	31/03/2026	4 145 325.75	3 965 342.46	12 424.56	-192 407.85	0.81
US09659W2P81	BNP PARIBAS VAR 19/04/2032	4 900 000.000	90.78800	USD	31/03/2026	3 935 767.87	3 915 915.25	54 943.20	-74 795.82	0.80
US101137AL15	BOSTON SCIENTIFIC 7.375% 15/01/2040	2 500 000.000	118.58800	USD	31/03/2026	2 604 283.48	2 606 859.58	33 781.99	-31 205.89	0.53
US05571AAY10	BPCE SA VAR 30/05/2035	5 100 000.000	102.30300	USD	31/03/2026	4 714 054.38	4 616 564.77	88 311.86	-185 801.47	0.95
US14739LAB80	CASCADES INC USA INC 5.375% 15/01/2028	290 000.000	99.08700	USD	31/03/2026	246 015.75	252 250.47	2 856.01	3 378.71	0.05
US149123CH22	CATERPILLAR INC 2.6% 09/04/2030	3 700 000.000	93.89700	USD	31/03/2026	3 101 023.04	3 055 156.41	39 890.83	-85 757.46	0.63
US17275RBR21	CISCO SYSTEMS INC 4.85% 26/02/2029	4 122 000.000	101.87000	USD	31/03/2026	3 843 455.61	3 661 272.16	16 868.93	-199 052.38	0.75
US172967EW71	CITIGROUP 8.125% 15/07/39	4 000 000.000	124.76100	USD	31/03/2026	4 602 048.96	4 390 775.13	59 547.92	-270 821.75	0.90
US191216DJ60	COCA COLA CO 1.5% 05/03/2028	4 534 000.000	95.58500	USD	31/03/2026	3 819 129.81	3 765 609.90	4 263.00	-57 782.91	0.77
US20030NEJ63	COMCAST CORP 5.30% 01/06/2034	4 644 000.000	101.58900	USD	31/03/2026	4 313 249.65	4 165 802.08	71 206.39	-218 653.96	0.85
US126650EB25	CVS HEALTH CORP 5.40% 01/06/2029	2 338 000.000	102.40700	USD	31/03/2026	2 194 346.02	2 114 528.43	36 524.91	-116 342.50	0.43
US244199BJ37	DEERE AND COMPANY 3.1% 15/04/2030	4 670 000.000	95.51800	USD	31/03/2026	3 988 679.80	3 929 392.17	57 937.04	-117 224.67	0.81
US251526CX52	DEUTSCHE BANK NY VAR 11/09/2030	5 450 000.000	100.44900	USD	31/03/2026	4 901 087.50	4 765 112.96	13 793.31	-149 767.85	0.98
US25156PAD50	DEUTSCHE TELEKOM 9.25% 01/06/2032	1 500 000.000	122.82800	USD	31/03/2026	1 742 362.62	1 639 185.91	40 140.60	-143 317.31	0.34
US532457CR72	ELI LILLY & CO 4.6% 14/08/2034	5 500 000.000	99.10200	USD	31/03/2026	4 890 005.96	4 759 278.39	28 667.38	-159 394.95	0.98
US31428XCD66	FEDEX CORP 2.4% 15/05/2031	1 000 000.000	90.00000	USD	31/03/2026	800 388.53	788 983.40	7 869.01	-19 274.14	0.16
US30251GBA40	FMG RESOURCES AUG 2006 4.5% 15/09/2027	195 000.000	99.17300	USD	31/03/2026	164 868.82	168 180.31	338.48	2 973.01	0.03
US345397G230	FORD MOTORS CREDIT CO LLC 5.303% 06/09/2029	2 400 000.000	99.55300	USD	31/03/2026	2 183 200.74	2 081 331.65	7 670.83	-109 539.92	0.43

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
US37045XDE31	GENERAL MOTORS FINL CO 2.35% 08/01/2031	6 438 000.000	89.11700	USD	31/03/2026	4 995 390.92	5 009 749.96	30 273.77	-15 914.73	1.03
US38141GGM06	GSACHS G 6.25% 01/02/41 *USD	4 000 000.000	105.66300	USD	31/03/2026	3 883 058.66	3 704 380.03	36 162.71	-214 841.34	0.76
US437076DD13	HOME DEPOT INC 4.85% 25/06/2031	4 408 000.000	102.27200	USD	31/03/2026	4 074 929.38	3 962 124.54	49 479.37	-162 284.21	0.81
US404280DW61	HSBC HOLDINGS PLC VAR 09/03/2044	4 400 000.000	105.49300	USD	31/03/2026	4 358 382.72	4 043 324.11	14 776.98	-329 835.59	0.83
US459200KB68	IBM CORP 4.15% 15/05/2039	5 500 000.000	86.85400	USD	31/03/2026	4 428 334.42	4 220 793.07	74 837.51	-282 378.86	0.87
US449691AC82	ILIAD HOLDING SAS 7% 15/10/2028	400 000.000	100.67700	USD	31/03/2026	350 284.04	360 717.85	11 205.62	-771.81	0.07
US458140CN85	INTEL CORP 5.0% 21/02/2021	2 418 000.000	100.89800	USD	31/03/2026	2 225 477.09	2 129 098.22	11 658.85	-108 037.72	0.44
US46115HBV87	INTESA SANPAOLO SPA 8.248% 21/11/2033	4 900 000.000	115.34200	USD	31/03/2026	5 137 715.63	5 031 853.65	126 665.32	-232 527.30	1.03
US46625HHF01	JPMORGAN CHASE 6.4% 15/05/38	5 485 000.000	110.04300	USD	31/03/2026	5 668 856.09	5 353 648.38	115 097.30	-430 305.01	1.10
US50077LAV80	KRAFT HEINZ FOODS CO 3.75% 01/04/2030	3 436 000.000	96.82000	USD	31/03/2026	2 985 550.62	2 887 289.71		-98 260.91	0.59
US571676BC81	MARS INC 5.7% 01/05/2055	5 000 000.000	97.66600	USD	31/03/2026	4 508 387.39	4 341 303.59	103 063.70	-270 147.50	0.89
US58933YBK01	MERCK CO INC 4.5% 17/05/2033	3 609 000.000	99.68300	USD	31/03/2026	3 229 143.46	3 174 804.91	52 465.50	-106 804.05	0.65
US59217HEC79	MET LIFE GLOB FOUNDING 1 5.05% 08/01/2034	4 800 000.000	100.63700	USD	31/03/2026	4 458 671.60	4 240 984.79	48 504.31	-266 191.12	0.87
US30303M8V78	META PLATFORMS INC 5.40% 15/08/2054	4 734 000.000	90.60600	USD	31/03/2026	4 400 824.50	3 751 043.78	28 349.77	-678 130.49	0.77
US55305BAS07	MI HOMES INC 4.95% 01/02/2028	200 000.000	99.03700	USD	31/03/2026	168 850.06	173 341.43	1 432.04	3 059.33	0.04
US606822BY90	MITSUBISHI UFJ FIN GRB VAR 20/7/2027	4 500 000.000	99.12200	USD	31/03/2026	3 918 587.22	3 883 127.71	11 846.68	-47 306.19	0.80
US60687YAT64	MIZUHO FINANCIAL GROUP VAR 11/09/2029	4 400 000.000	99.39200	USD	31/03/2026	3 961 546.90	3 804 588.33	9 025.06	-165 983.63	0.78
US61747YEF88	MORGAN STAN VAR 16/09/2036	6 819 000.000	86.05400	USD	31/03/2026	5 149 159.30	5 099 010.53	6 125.39	-56 274.16	1.05
US61747YFE05	MORGAN STANLEY VAR 21/04/2034	3 000 000.000	100.43500	USD	31/03/2026	2 702 477.69	2 675 794.13	60 753.34	-87 436.90	0.55
US636274AE20	NATIONAL GRID PLC 5.809% 12/06/2033	3 000 000.000	104.42900	USD	31/03/2026	2 846 016.51	2 764 828.22	45 795.07	-126 983.36	0.57
US632525BN08	NATL AUSTRALIA BANK 4.951% 10/01/2034	3 750 000.000	101.00400	USD	31/03/2026	3 476 954.21	3 323 575.82	36 255.91	-189 634.30	0.68
US68389XCS27	ORACLE CORP 4.2% 27/09/2029	4 474 000.000	96.92300	USD	31/03/2026	4 012 175.62	3 765 338.39	1 812.07	-248 649.30	0.77
US713448FL73	PEPSICO INC 3.6% 18/02/2028	3 000 000.000	99.32500	USD	31/03/2026	2 698 840.74	2 597 335.53	11 195.97	-112 701.18	0.53
US716973AF98	PFIZER INVESTMENT ENTER 5.11% 19/05/2043	5 000 000.000	94.54600	USD	31/03/2026	4 392 307.19	4 184 154.95	81 308.22	-289 460.46	0.86
US771196CM28	ROCHE HOLDINGS INC 5.128% 08/03/2054	3 600 000.000	95.55900	USD	31/03/2026	3 325 254.39	2 996 116.47	10 416.07	-339 553.99	0.61
US78016EYH43	ROYAL BANK OF CANADA 2.3% 03/11/2031	5 462 000.000	89.30400	USD	31/03/2026	4 272 789.44	4 278 276.97	44 824.02	-39 336.49	0.88
US83368TBL17	SOCIETE GENERALE VAR 15/06/2033	2 400 000.000	103.17800	USD	31/03/2026	2 264 347.82	2 187 323.15	38 154.60	-115 179.27	0.45
US86562MCS70	SUMITOMO MITSUI FINANCIAL CORP INC 5.766% 13/01/2033	3 400 000.000	104.20300	USD	31/03/2026	3 305 076.78	3 111 767.23	36 865.30	-230 174.85	0.64
US87264ADL61	T MOBILE USA INC 4.2% 01/10/2029	2 470 000.000	99.34400	USD	31/03/2026	2 235 795.56	2 129 662.21		-106 133.35	0.44
BE6300372289	TELENET FINANCE LUX NOTE 5.5% 01/03/2028	200 000.000	98.64800	USD	31/03/2026	169 698.74	173 276.15	2 041.99	1 535.42	0.04
US87264ADZ57	T-MOBILE USA INC 5% 15/02/2036	2 400 000.000	98.46200	USD	31/03/2026	2 019 687.18	2 073 790.43	22 854.83	31 248.42	0.43

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
US89236TLZ65	TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 5.10% 21/03/2031	3 524 000.000	102.31800	USD	31/03/2026	3 324 915.19	3 133 725.61	4 332.87	-195 522.45	0.64
US902613BL18	UBS GROUP AG VAR 13/09/2030	4 300 000.000	103.04600	USD	31/03/2026	4 055 936.82	3 856 148.72	10 481.30	-210 269.40	0.79
US91324PFG28	UNITEDHEALTH GROUP INC 4.80% 15/01/2030	3 538 000.000	101.18400	USD	31/03/2026	3 303 235.21	3 138 119.81	31 115.89	-196 231.29	0.64
US92343VFR06	VERIZON COMMUNICATIONS 1.75% 20/01/2031	3 000 000.000	87.81500	USD	31/03/2026	2 288 539.95	2 295 438.44	8 986.43	-2 087.94	0.47
US931142FE87	WALMART INC 4.5% 15/04/2053	5 242 000.000	86.74400	USD	31/03/2026	4 414 093.74	4 040 871.36	94 403.32	-467 625.70	0.83
US254687FX90	WALT DISNEY COMPANY 2.65% 13/01/2031	5 296 000.000	92.82600	USD	31/03/2026	4 325 554.22	4 293 067.90	26 391.14	-58 877.46	0.88
USU94303AE12	WEA FINANACE LLC 3.5% 15/06/2029	3 500 000.000	96.53000	USD	31/03/2026	2 934 334.65	2 963 564.87	31 304.84	-2 074.62	0.61
US95000U2Q52	WELLS FARGO AND COMPANY VAR 30/04/2041	4 639 000.000	75.13500	USD	31/03/2026	3 246 742.12	3 076 904.95	51 811.52	-221 648.69	0.63
US95081QAP90	WESCO DISTRIBUTION INC 7.25% 15/06/2028	280 000.000	100.62600	USD	31/03/2026	244 090.21	249 722.29	5 187.66	444.42	0.05
US961214EP44	WESTPAC BANKING CORP VAR 15/11/2035	5 438 000.000	89.83200	USD	31/03/2026	4 277 947.82	4 287 341.06	47 570.05	-38 176.81	0.88
US98212BAM54	WPX ENERGY INC 5.875% 15/06/2028	109 000.000	99.98290	USD	31/03/2026	93 258.15	96 221.93	1 636.48	1 327.30	0.02

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
Total Obligation						235 985 530.85	227 309 411.23	2 412 575.79	-11 088 695.41	46.62
Sicav (O.P.C.V.M.)										
LU1184721287	AVIVA INVESTORS SICAV EMERGING MARKETS CORPORATE BOND SICAV	0.001	791.68970	EUR	30/03/2026	0.97	0.79		-0.18	
FR0007030663	OFI INVEST CREDIT EUROPE FCP	59 435.924	666.39000	EUR	31/03/2026	40 117 400.21	39 607 505.33		-509 894.88	8.12
FR0010645325	OFI INVEST ESG ALPHA YIELD FCP	42.900	1 682 847.51000	EUR	30/03/2026	61 785 355.28	72 194 158.18		10 408 802.90	14.81
FR0010596783	OFI INVEST ESG EURO HIGH YIELD PART C	547 165.577	130.64000	EUR	31/03/2026	63 608 837.17	71 481 711.02		7 872 873.85	14.66
FR0011869163	OFI INVEST ESG EURO INVESTMENT GRADE CLIMATE FOCUS CH	3 498.000	11 321.93000	EUR	31/03/2026	37 388 097.22	39 604 111.14		2 216 013.92	8.12
FR0011024249	OFI INVEST ISR CREDIT BONDS EURO PART I	20 770.031	1 451.92000	EUR	31/03/2026	27 938 931.51	30 156 423.55		2 217 492.04	6.18
FR001400Z826	OFI INVEST SUB DEBT OPPORTUNITIES PARTS I	4 789.000	1 020.48000	EUR	31/03/2026	4 904 750.13	4 887 078.72		-17 671.41	1.00
Total Sicav (O.P.C.V.M.)						235 743 372.49	257 930 988.73		22 187 616.24	52.90
Total Valeurs mobilières						471 728 903.34	485 240 399.96	2 412 575.79	11 098 920.83	99.52
Coupons										
Obligation										
US50077LAV80	KRAFT 3.75% 2030	3 436.000		USD	31/03/2026	55 914.77	55 914.77			0.01
US87264ADL61	TMUS 4.2 10/01/29	2 470.000		USD	31/03/2026	45 018.23	45 018.23			0.01
Total Obligation						100 933.00	100 933.00			0.02
Total Coupons						100 933.00	100 933.00			0.02
Futures										
Taux (Livraison du sous-jacent)										
G300626	LONG GILT 0626	95.000	87.79000	GBP	31/03/2026		-507 119.15		-507 119.15	-0.10
UXY300626	US 10YR ULT 0626	397.000	113.51563	USD	31/03/2026		-791 405.48		-791 405.48	-0.16
Total Taux (Livraison du sous-jacent)							-1 298 524.63		-1 298 524.63	-0.27
Total Futures							-1 298 524.63		-1 298 524.63	-0.27
Liquidites										
APPELS DE MARGES										
MGBNPEUR	Appel de marge EUR	2 374 646.200	1.00000	EUR	31/03/2026	2 374 646.20	2 374 646.20			0.49
MGGBP	Appel marge GBP	443 070.000	1.14456	GBP	31/03/2026	512 115.01	507 119.15		-4 995.86	0.10
MGUSD	Appel marge USD	911 857.390	0.86790	USD	31/03/2026	789 810.64	791 405.48		1 594.84	0.16
Total APPELS DE MARGES						3 676 571.85	3 673 170.83		-3 401.02	0.75
AUTRES										
RMF065EUR	Prov com mvts EUR	-2 740.110	1.00000	EUR	31/03/2026	-2 740.11	-2 740.11			
Total AUTRES							-2 740.11		-2 740.11	
BANQUE OU ATTENTE										
BK065EUR	Banque EUR SGP	-2 106 036.840	1.00000	EUR	31/03/2026	-2 106 036.84	-2 106 036.84			-0.43
BK065GBP	Banque GBP SGP	29 663.970	1.14456	GBP	31/03/2026	34 062.67	33 952.12		-110.55	0.01
BK065USD	Banque USD SGP	1 741 394.560	0.86790	USD	31/03/2026	1 504 720.58	1 511 364.83		6 644.25	0.31
Total BANQUE OU ATTENTE						-567 253.59	-560 719.89		6 533.70	-0.11
DEPOSIT DE GARANTIE										
CLRBPAEUR	Collatéral esp Recu	-330 000.000	1.00000	EUR	31/03/2026	-330 000.00	-330 000.00			-0.07
CLVUBSEUR	Collatéral esp Versé	4 430 000.000	1.00000	EUR	31/03/2026	4 430 000.00	4 430 000.00			0.91
DFPGBP	Dep gar s/FUT GBP	217 550.000	1.14456	GBP	31/03/2026	249 330.29	248 998.51		-331.78	0.05
DFPUSD	Dep gar s/FUT USD	1 012 350.000	0.86790	USD	31/03/2026	886 827.59	878 623.50		-8 204.09	0.18

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
DFPBNPEUR	Deposit OTC Verse	1 909 788.710	1.00000	EUR	31/03/2026	1 909 788.71	1 909 788.71			0.39

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
Total DEPOSIT DE GARANTIE						7 145 946.59	7 137 410.72		-8 535.87	1.46
FRAIS DE GESTION										
F110EUR	PrComGestFin	-407 038.550	1.00000	EUR	31/03/2026	-407 038.55	-407 038.55			-0.08
F120EUR-	PrN-1ComGestAdm	1 601.640	1.00000	EUR	31/03/2026	1 601.64	1 601.64			
F130EUR-	PrN-1ComGestDep	3 419.710	1.00000	EUR	31/03/2026	3 419.71	3 419.71			
F155EUR-	PrN-1HonoCAC	-3 049.150	1.00000	EUR	31/03/2026	-3 049.15	-3 049.15			
Total FRAIS DE GESTION						-405 066.35	-405 066.35			-0.08
Total Liquidites						9 847 458.39	9 842 055.20		-5 403.19	2.02
Derives de credit										
CDS										
CDS-00108260	263KBAMLE01A709D2858	-36 900 000.000	6.43536	EUR	31/03/2026	-2 494 694.32	-2 374 646.20	-66 625.00	186 673.12	-0.49
Total CDS						-2 494 694.32	-2 374 646.20	-66 625.00	186 673.12	-0.49
Total Derives de credit						-2 494 694.32	-2 374 646.20	-66 625.00	186 673.12	-0.49
Change a terme										
Change a terme										
OACT01966282	OACT 260415 USD/EUR	-21 235 886.100	1.00000	EUR	31/03/2026	-21 235 886.10	-21 235 886.10			-4.36
OACT01966282	OACT 260415 USD/EUR	25 000 000.000	0.86735	USD	31/03/2026	21 235 886.10	21 683 864.07		447 977.97	4.45
OVCT01721688	OVCT 260415 USD/EUR	237 848 660.570	1.00000	EUR	31/03/2026	237 848 660.57	237 848 660.57			48.78
OVCT01728646	OVCT 260415 USD/EUR	12 179 070.980	1.00000	EUR	31/03/2026	12 179 070.98	12 179 070.98			2.50
OVCT01728646	OVCT 260415 USD/EUR	-14 500 000.000	0.86740	USD	31/03/2026	-12 179 070.98	-12 577 239.26		-398 168.28	-2.58
OVCT01721688	OVCT 260415 USD/EUR	-278 791 929.000	0.86735	USD	31/03/2026	-237 848 660.57	-241 811 486.51		-3 962 825.94	-49.59
Total Change a terme							-3 913 016.25		-3 913 016.25	-0.80
Total Change a terme							-3 913 016.25		-3 913 016.25	-0.80

v Cours des devises utilisées

Devise	Date du cours	Cours utilisé	Cours inverse
EUR/GBP	31/03/2026	0.87370000	1.14455763
EUR/USD	31/03/2026	1.15220000	0.86790488
USD/EUR	31/03/2026	0.86790488	1.15220000