

Ofi Invest ISR Monétaire CT

Fonds Commun de Placement

Société de Gestion :

OFI Invest Asset Management

127-129, quai du Président Roosevelt

92130 ISSY LES MOULINEAUX

Attestation du Commissaire aux Comptes relative à la composition de l'actif

au 31 mars 2026

Ofi Invest ISR Monétaire CT

Fonds Commun de Placement

Société de Gestion :
OFI Invest Asset Management

127-129, quai du Président Roosevelt
92130 ISSY LES MOULINEAUX

Attestation du Commissaire aux Comptes relative à la composition de l'actif

au 31 mars 2026

En notre qualité de commissaire aux comptes du Fonds Commun de Placement Ofi Invest ISR Monétaire CT et en application des dispositions prévues par l'article L214-24-49 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. 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 Ofi Invest ISR Monétaire CT acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

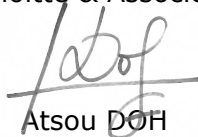
Nous avons mis en œuvre les diligences que nous avons estimé nécessaires au regard de la doctrine professionnelle de la Compagnie nationale des commissaires aux comptes relative à cette intervention. Ces diligences, qui ne constituent ni un audit ni un examen limité, ont consisté essentiellement à réaliser 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 Ofi Invest ISR Monétaire CT acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

A Paris La Défense, le 26 mai 2026

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés



Atsou DOH

Inventaire du portefeuille OFI INVEST ISR MONÉTAIRE CT au 31/03/2026

▼ Descriptif du portefeuille

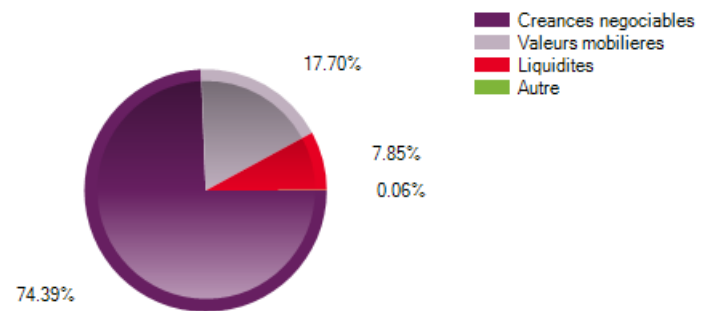
Libellé	Code	Actif net	Dev	Statut VL
OFI INVEST ISR MONÉTAIRE CT	FAMZ18	3 140 877 191,13 EUR		OFF

▼ Synthèse

Part	Code ISIN	VL	Actif de la part	Dev	Nombre de parts
C	FR0000985558	2 445,13	2 565 091 950,97000	EUR	1 049 058,5197
CP	FR001400CQH6	110,84	193 885 001,11000	EUR	1 749 165,1087
D	FR0010510479	10 138,49	419 323,07000	EUR	41,3595
E	FR0010738229	1 114,84	10 902 591,78000	EUR	9 779,4646
F	FR0010694125	3 396,12	370 578 324,20000	EUR	109 117,8404

Valeur boursière	Prix de revient	+/- value	Intérêts courus
Valeurs mobilières			
556 004 621,15	551 672 923,61	-157 016,82	4 488 714,36
Creances negociables			
2 336 348 925,83	2 320 322 542,65	6 940 673,55	9 085 709,63
Swap de Taux			
1 865 983,66		1 398 636,27	467 347,39
Liquidités			
246 657 660,49	246 219 670,24	-4,47	437 994,72
Total			
3 140 877 191,13	3 118 215 136,50	8 182 288,53	14 479 766,10

Répartition de l'actif net du portefeuille par type d'instrument



v Détails

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
Valeurs mobilières										
Obligation										
XS2101349723	BANCO BILBAO VIZCAYA ARG 0.5% 14/01/2027	4 000 000,000	98,12600	EUR	30/03/2026	3 933 200,00	3 929 204,38	4 164,38	-8 160,00	0,13
XS2013745703	BANCO BILBAO VIZCAYA ARG 1% 21/06/2026	21 400 000,000	99,67600	EUR	30/03/2026	21 180 747,00	21 496 587,29	165 923,29	149 917,00	0,68
FR0013412947	BANQUE FED CRED MUTUEL 0.75% 08/06/2026	20 000 000,000	99,68000	EUR	30/03/2026	19 832 735,00	20 057 643,84	121 643,84	103 265,00	0,64
XS2625968693	BMW FINANCE NV 3.25% 22/11/2026	30 000 000,000	100,31800	EUR	30/03/2026	30 224 100,00	30 439 989,04	344 589,04	-128 700,00	0,97
FR0013444759	BNP PARIBAS 0.125% 04/09/2026	15 000 000,000	98,98000	EUR	30/03/2026	14 795 839,00	14 857 684,93	10 684,93	51 161,00	0,47
FR001400HAC0	BPCE SA 3.625% 17/04/2026	26 200 000,000	100,05100	EUR	30/03/2026	26 368 882,00	27 118 877,07	905 515,07	-155 520,00	0,86
XS1401174633	HEINEKEN NV 1% 04/05/2026	10 500 000,000	99,86200	EUR	30/03/2026	10 473 750,00	10 580 729,18	95 219,18	11 760,00	0,34
XS1945110606	IBM 1 1/4 01/29/27 1.25% 29/01/2027	3 124 000,000	98,86700	EUR	30/03/2026	3 094 254,40	3 095 131,24	6 526,16	-5 649,32	0,10
XS2625195891	INTESA SANPAOLO SPA 4% 19/05/2026	46 499 000,000	100,17600	EUR	30/03/2026	47 033 280,20	48 191 104,98	1 610 266,74	-452 441,96	1,53
FR0013433596	LA BANQUE POSTALE 0.25% 12/07/2026	8 800 000,000	99,38500	EUR	30/03/2026	8 689 395,00	8 761 671,78	15 791,78	56 485,00	0,28
FR0013508686	LA POSTE SA 0.625% 21/10/2026	9 400 000,000	98,99400	EUR	30/03/2026	9 292 370,00	9 331 350,38	25 914,38	13 066,00	0,30
XS2013525501	LLOYDS BANK PLC 0.125% 18/06/2026	1 000 000,000	99,55400	EUR	30/03/2026	980 200,00	996 519,45	979,45	15 340,00	0,03
XS2151069775	LLOYDS BK CORP MKTS PLC 2.375% 09/04/2026	31 300 000,000	100,00100	EUR	30/03/2026	31 353 759,98	32 025 358,21	725 045,21	-53 446,98	1,02
XS2355599197	NATWEST MARKETS PLC 0.125% 18/06/2026	9 088 000,000	99,51900	EUR	30/03/2026	8 965 712,22	9 053 187,98	8 901,26	78 574,50	0,29
FR0013430733	SOCIETE GENERALE 0.875% 01/07/2026	4 100 000,000	99,57700	EUR	30/03/2026	4 074 420,00	4 109 489,53	26 832,53	8 237,00	0,13
FR001400U1B5	SOCIETE GENERALE 3% 12/02/2027	12 000 000,000	100,12000	EUR	30/03/2026	12 082 170,00	12 060 756,16	46 356,16	-67 770,00	0,38
FR001400KZP3	SOCIETE GENERALE 4.25% 28/09/2026	7 800 000,000	100,79300	EUR	30/03/2026	7 947 936,00	8 028 966,33	167 112,33	-86 082,00	0,26
XS2479941499	VISA INC 1.5% 15/06/2026	17 450 000,000	99,80400	EUR	30/03/2026	17 400 620,00	17 623 046,63	207 248,63	15 178,00	0,56
Total Obligation						277 723 370,80	281 757 298,40	4 488 714,36	-454 786,76	8,97
Sicav (O.P.C.V.M.)										
FR0013067808	BFT MONETARIE COURT TERME ISR C LIMAT SICAV	12 430,000	10 808,79000	EUR	30/03/2026	134 234 946,61	134 353 259,70		118 313,09	4,28
FR001400R6M6	OSTRUM SRI CASH PLUS SICAV	535,000	261 484,23000	EUR	30/03/2026	139 714 606,20	139 894 063,05		179 456,85	4,45
Total Sicav (O.P.C.V.M.)						273 949 552,81	274 247 322,75		297 769,94	8,73
Total Valeurs mobilières						551 672 923,61	556 004 621,15	4 488 714,36	-157 016,82	17,70
Creances negociables										
Interets postcomptes.										
FR0129582542	AGENCE CENTRALE ORGANISMES OISEST +0.19 25/06/2026	30 000 000,000	99,99310	EUR	31/03/2026	30 000 000,00	30 056 320,75	58 390,75	-2 070,00	0,96
FR0129175214	AXA BANQUE OISEST+0.33% 05/05/2026	40 000 000,000	100,02200	EUR	31/03/2026	40 000 000,00	40 855 461,22	846 661,22	8 800,00	1,30
FR0129514099	AXA BANQUE S A OISEST+0.21% 21/04/2026	25 000 000,000	100,00720	EUR	31/03/2026	25 000 000,00	25 197 135,56	195 335,56	1 800,00	0,80

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
FR0129201952	AXA BANQUE S.A. OISEST +.33% 14/05/2026	50 000 000,000	100,02510	EUR	31/03/2026	50 000 000,00	51 039 148,61	1 026 598,61	12 550,00	1,62
FR0129155679	AXA BANQUE SA OISEST+0.3% 17/04/2026	20 000 000,000	100,00980	EUR	31/03/2026	20 000 000,00	20 445 694,11	443 734,11	1 960,00	0,65
FR0129163756	BANQUE FEDERATIVE DE CREDI OISEST+0.32% 01/04/2026	30 000 000,000	100,00060	EUR	31/03/2026	30 000 000,00	30 645 029,50	644 849,50	180,00	0,98
FR0129111193	BANQUE FEDERATIVE DU OISEST + 0.3% 02/04/2026	20 000 000,000	100,00110	EUR	31/03/2026	20 000 000,00	20 463 901,78	463 681,78	220,00	0,65
FR0129488716	BANQUE FEDERATIVE DU OISEST + 0.33% 13/11/2026	10 000 000,000	100,01110	EUR	31/03/2026	10 000 000,00	10 088 664,56	87 554,56	1 110,00	0,32
FR0129672038	BANQUE FEDERATIVE DU OISEST+0.30% 11/12/2026	20 000 000,000	99,98150	EUR	31/03/2026	20 000 000,00	20 019 861,06	23 561,06	-3 700,00	0,64
FR0129499382	BANQUE PALATINE SA OISEST +0.33% 13/11/2026	25 000 000,000	100,02040	EUR	31/03/2026	25 000 000,00	25 222 402,08	217 302,08	5 100,00	0,80
FR0129673788	BFCM OISEST +.34% 20/01/2027	10 000 000,000	99,99410	EUR	31/03/2026	10 000 000,00	10 006 982,00	7 572,00	-590,00	0,32
FR0129439719	BPCE OISEST .3% 15/09/2026	25 000 000,000	100,03990	EUR	31/03/2026	25 000 000,00	25 271 168,33	261 193,33	9 975,00	0,80
FR0129266872	BPCE SA OISEST + 0.32% 10/07/2026	20 000 000,000	100,04220	EUR	31/03/2026	20 000 000,00	20 340 126,67	331 686,67	8 440,00	0,65
FR0129111094	BPCE SA OISEST +.3% 02/04/2026	6 000 000,000	100,00130	EUR	31/03/2026	5 998 878,00	6 139 182,53	139 104,53	1 200,00	0,20
FR0129621944	CA CONSUMER FINANCE OISEST + 0.35% 05/02/2027	20 000 000,000	100,00330	EUR	31/03/2026	20 000 000,00	20 060 297,78	59 637,78	660,00	0,64
FR0129654705	CA CONSUMER FINANCE SA OISEST +0.23% 06/08/2026	20 000 000,000	100,00430	EUR	31/03/2026	20 000 000,00	20 032 100,44	31 240,44	860,00	0,64
FR0129548600	CREDIT AGRICOLE SA OISEST + 0.33% 15/12/2026	30 000 000,000	100,01270	EUR	31/03/2026	30 000 000,00	30 160 507,08	156 697,08	3 810,00	0,96
FR0129671907	CREDIT AGRICOLE SA OISEST +0.26% 13/10/2026	15 000 000,000	99,99420	EUR	31/03/2026	15 000 000,00	15 016 484,13	17 354,13	-870,00	0,48
FR0129671923	CREDIT AGRICOLE SA OISEST+0.27%13/11/2026	15 000 000,000	99,98940	EUR	31/03/2026	15 000 000,00	15 015 843,29	17 433,29	-1 590,00	0,48
FR0129671964	CREDIT AGRICOLE SA OISEST+0.31% 13/01/2027	15 000 000,000	99,98870	EUR	31/03/2026	15 000 000,00	15 016 054,96	17 749,96	-1 695,00	0,48
FR0129653319	CREDIT INDUSTRIEL E OISEST .26% 02/10/2026	10 000 000,000	99,98620	EUR	31/03/2026	10 000 000,00	10 016 287,44	17 667,44	-1 380,00	0,32
FR0129653343	CREDIT INDUSTRIEL ET OISEST .32%03/02/2027	20 000 000,000	99,97120	EUR	31/03/2026	20 000 000,00	20 030 541,56	36 301,56	-5 760,00	0,64
FR0129417244	CREDIT LYONNAIS OISEST+0.28% 10/07/2026	30 000 000,000	100,02450	EUR	31/03/2026	30 000 000,00	30 327 241,42	319 891,42	7 350,00	0,97
FR0129234854	CREDIT LYONNAIS SA OISEST+0.33% 03/06/2026	35 000 000,000	100,03090	EUR	31/03/2026	35 000 000,00	35 680 130,89	669 315,89	10 815,00	1,14
FR0129410561	CREDIT LYONNAIS SA OISEST+0.33% 22/09/2026	30 000 000,000	100,02980	EUR	31/03/2026	30 000 000,00	30 370 136,92	361 196,92	8 940,00	0,97
FR0129213460	ING BANK NV OISEST .3% 19/05/2026	30 000 000,000	100,02560	EUR	31/03/2026	30 000 000,00	30 605 145,75	597 465,75	7 680,00	0,97
FR0129251379	ING BANK NV OISEST+0.3% 05/06/2026	40 000 000,000	100,03220	EUR	31/03/2026	40 000 000,00	40 759 416,56	746 536,56	12 880,00	1,30
FR0129446847	ING BANK NV OISEST+0.30% 22/10/2026	30 000 000,000	100,02710	EUR	31/03/2026	30 000 000,00	30 306 596,67	298 466,67	8 130,00	0,96
FR0129580793	ING BANK OISEST+0.31% 29/12/2026	20 000 000,000	100,00740	EUR	31/03/2026	20 000 000,00	20 078 787,11	77 307,11	1 480,00	0,64
FR0129516672	LA BANQUE POSTALE OISEST +0.215% 30/07/2026	10 000 000,000	100,01640	EUR	31/03/2026	10 000 000,00	10 038 058,69	36 418,69	1 640,00	0,32
FR0129516698	LA BANQUE POSTALE OISEST +0.295% 29/01/2027	15 000 000,000	100,01050	EUR	31/03/2026	15 000 000,00	15 058 236,38	56 661,38	1 575,00	0,48
FR0129081750	LA BANQUE POSTALE OISEST 21/04/2026	20 000 000,000	100,01250	EUR	31/03/2026	20 000 000,00	20 436 647,11	434 147,11	2 500,00	0,65

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
FR0129516185	LA BANQUE POSTALE OISEST+0.3% 04/12/2026	30 000 000,000	100,02980	EUR	31/03/2026	30 000 000,00	30 167 302,08	158 362,08	8 940,00	0,96
XS3059595531	LLOYDS BANK CORPORATE OISEST + 0.35% 21/04/2026	5 000 000,000	100,01560	EUR	31/03/2026	5 002 590,00	5 112 183,44	111 403,44	-1 810,00	0,16
FR0129439065	PALATINE SA OISEST +0.33% 14/10/2026	10 000 000,000	100,02760	EUR	31/03/2026	10 000 000,00	10 108 632,67	105 872,67	2 760,00	0,32
FR0129634376	SOCIETE GENERALE SA OISEST+0.34% 22/03/2027	20 000 000,000	99,98250	EUR	31/03/2026	20 000 000,00	20 007 856,50	11 356,50	-3 500,00	0,64

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
Total Interets postcomptes.						801 001 468,00	810 195 567,63	9 085 709,63	108 390,00	25,80
Interets precomptes.										
XS3325326695	ABN AMRO GROUP BANK NV ZCP 17/07/2026	10 000 000,000	99,30950	EUR	31/03/2026	9 926 379,35	9 930 950,00		4 570,65	0,32
FR0129547909	ACHMEA BANK NV ZCP 08/01/2027	9 500 000,000	97,86330	EUR	31/03/2026	9 286 273,83	9 297 013,50		10 739,67	0,30
FR0129672715	ACHMEA BANK NV ZCP 12/03/2027	15 000 000,000	97,29170	EUR	31/03/2026	14 614 185,50	14 593 755,00		-20 430,50	0,46
FR0129174506	ACHMEA BANK ZCP 30/04/2026	10 000 000,000	99,82590	EUR	31/03/2026	9 789 740,84	9 982 590,00		192 849,16	0,32
XS3294949774	AGENCE CENTRALE ORG ZCP 06/05/2026	15 000 000,000	99,79570	EUR	31/03/2026	14 922 343,71	14 969 355,00		47 011,29	0,48
XS3290508822	AGENCE CENTRALE ORGANISMES SECU ZCP 04/05/2026	20 000 000,000	99,80800	EUR	31/03/2026	19 895 548,37	19 961 600,00		66 051,63	0,64
FR0129513703	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARI ZCP 20/08/2026	20 000 000,000	99,08010	EUR	31/03/2026	19 672 542,34	19 816 020,00		143 477,66	0,63
FR0129513075	BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA ZCP 19/11/2026	40 000 000,000	98,36110	EUR	31/03/2026	39 114 108,89	39 344 440,00		230 331,11	1,25
XS3047943058	BANCO SANTANDER SA ZCP 02/04/2026	25 000 000,000	99,98890	EUR	31/03/2026	24 905 566,40	24 997 225,00		91 658,60	0,80
BE6368510721	BELFIUS BANK BELGIU ZCP 10/04/2026	10 000 000,000	99,94580	EUR	31/03/2026	9 894 206,20	9 994 580,00		100 373,80	0,32
FR0129411429	BPIFRANCE SA ZCP 31/08/2026	20 000 000,000	99,01520	EUR	31/03/2026	19 604 767,88	19 803 040,00		198 272,12	0,63
XS3278651024	CAIXABANK SA ZCP 18/01/2027	8 500 000,000	97,89930	EUR	31/03/2026	8 312 570,02	8 321 440,50		8 870,48	0,26
XS3324629974	CARLSBERG BREWERIES ZCP 28/05/2026	10 000 000,000	99,63920	EUR	31/03/2026	9 956 114,28	9 963 920,00		7 805,72	0,32
XS3325957507	COCA COLA HBC FINANCE ZCP 19/03/2027	10 000 000,000	97,18750	EUR	31/03/2026	9 744 325,15	9 718 750,00		-25 575,15	0,31
FR0129653814	COFACE SA ZCP 02/04/2026	30 000 000,000	99,98800	EUR	31/03/2026	29 948 854,02	29 996 400,00		47 545,98	0,96
FR0129439222	COFACE SA ZCP 15/04/2026	15 000 000,000	99,91020	EUR	31/03/2026	14 920 177,05	14 986 530,00		66 352,95	0,48
BE6372774685	COFINIMMO SA ZCP 22/04/2026	48 000 000,000	99,86390	EUR	31/03/2026	47 903 833,06	47 934 672,00		30 838,94	1,53
BE6373027307	COFINIMMO SA ZCP 27/04/2026	20 000 000,000	99,83300	EUR	31/03/2026	19 960 699,60	19 966 600,00		5 900,40	0,64
DE000CZ459C2	COMMERZBANK AG ZCP 03/02/2027	10 000 000,000	97,73400	EUR	31/03/2026	9 775 144,52	9 773 400,00		-1 744,52	0,31
DE000CZ46AH6	COMMERZBANK AG ZCP 12/03/2027	20 000 000,000	97,41620	EUR	31/03/2026	19 504 985,15	19 483 240,00		-21 745,15	0,62
DE000CZ458N1	COMMERZBANK AG ZCP 13/11/2026	20 000 000,000	98,43540	EUR	31/03/2026	19 629 493,31	19 687 080,00		57 586,69	0,63
DE000CZ456M7	COMMERZBANK AG ZCP 14/09/2026	20 000 000,000	98,92150	EUR	31/03/2026	19 574 472,71	19 784 300,00		209 827,29	0,63
DE000CZ46AL8	COMMERZBANK AG ZCP 17/12/202026	15 000 000,000	98,13990	EUR	31/03/2026	14 722 772,24	14 720 985,00		-1 787,24	0,47
DE000CZ458Q4	COMMERZBANK AG ZCP 18/01/2027	20 000 000,000	97,86880	EUR	31/03/2026	19 551 255,24	19 573 760,00		22 504,76	0,62
DE000CZ454T7	COMMERZBANK AG ZCP 22/06/2026	15 000 000,000	99,51900	EUR	31/03/2026	14 680 128,16	14 927 850,00		247 721,84	0,48
FR0129544344	COVIVIO SA ZCP 16/04/2026	20 000 000,000	99,90600	EUR	31/03/2026	19 896 043,17	19 981 200,00		85 156,83	0,64
FR0129649531	DASSAULT SYSTEMES ZCP 16/04/2026	20 000 000,000	99,90620	EUR	31/03/2026	19 963 898,62	19 981 240,00		17 341,38	0,64
FR0129548634	EIFPAGE ZCP 09/04/2026	15 000 000,000	99,94750	EUR	31/03/2026	14 921 290,19	14 992 125,00		70 834,81	0,48
FR0129673069	ELECTRICITE DE FRANCE ZCP 17/04/2026	40 000 000,000	99,90200	EUR	31/03/2026	39 930 122,29	39 960 800,00		30 677,71	1,27
FR0129408680	ELIS SA ZCP 16/04/2026	24 000 000,000	99,90270	EUR	31/03/2026	23 867 831,88	23 976 648,00		108 816,12	0,76
XS3326554428	FIDELITY NATIONAL I ZCP 23/04/2026	36 000 000,000	99,86310	EUR	31/03/2026	35 933 473,17	35 950 716,00		17 242,83	1,14

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
FR0129622520	FINANCIERE AGACHE ZCP 15/05/2026	35 000 000,000	99,72520	EUR	31/03/2026	34 818 287,23	34 903 820,00		85 532,77	1,11
XS3315890395	IBERDROLA INTERNATI ZCP 08/05/2026	15 000 000,000	99,77100	EUR	31/03/2026	14 946 938,37	14 965 650,00		18 711,63	0,48
XS3326341511	IBERDROLA INTERNATIONAL BV ZCP 20/05/2026	30 000 000,000	99,69460	EUR	31/03/2026	29 889 591,17	29 908 380,00		18 788,83	0,95
XS3297678768	INTESA SANPAOLO BAN ZCP 10/02/2027	10 000 000,000	97,64550	EUR	31/03/2026	9 779 010,66	9 764 550,00		-14 460,66	0,31
XS3059474661	INTESA SANPAOLO BANK IRELAND ZCP 21/04/2026	5 000 000,000	99,88150	EUR	31/03/2026	4 893 765,00	4 994 075,00		100 310,00	0,16
XS3086812974	INTESA SANPAOLO BANK LUX ZCP 29/05/2026	40 000 000,000	99,65970	EUR	31/03/2026	39 179 963,37	39 863 880,00		683 916,63	1,27
XS3070546042	INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOUR ZCP 06/05/2026	10 000 000,000	99,79830	EUR	31/03/2026	9 794 505,83	9 979 830,00		185 324,17	0,32
XS3273012412	INTESA SANPAOLO BANK ZCP 08/01/2027	20 000 000,000	97,93490	EUR	31/03/2026	19 557 054,45	19 586 980,00		29 925,55	0,62
XS3154041423	INTESA SANPAOLO BANK ZCP 13/08/2026	12 500 000,000	99,12440	EUR	31/03/2026	12 231 322,02	12 390 550,00		159 227,98	0,39
XS3155652863	INTESA SANPAOLO BANK ZCP 17/08/2026	30 000 000,000	99,09390	EUR	31/03/2026	29 355 898,96	29 728 170,00		372 271,04	0,95
XS3325290560	JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC ZCP 19/06/2026	20 000 000,000	99,50590	EUR	31/03/2026	19 885 910,11	19 901 180,00		15 269,89	0,63
BE6367982293	KBC GROUP NV CDN 18/06/2026	30 000 000,000	99,52720	EUR	31/03/2026	29 501 111,62	29 858 160,00		357 048,38	0,95
BE6368907810	KBC GROUP NV ZCP 26/06/2026	10 000 000,000	99,47840	EUR	31/03/2026	9 850 351,30	9 947 840,00		97 488,70	0,32
FR0129497519	KERING FINANCE ZCP 12/05/2026	25 000 000,000	99,75170	EUR	31/03/2026	24 872 102,12	24 937 925,00		65 822,88	0,79
FR0129621878	LOC D EQUIPEMENTS ZCP 12/02/2027	15 000 000,000	97,57740	EUR	31/03/2026	14 657 646,24	14 636 610,00		-21 036,24	0,47
FR0129439685	MEDIOBANCA INTERNATIONAL (LUXE ZCP 14/10/2026	10 000 000,000	98,67290	EUR	31/03/2026	9 786 267,90	9 867 290,00		81 022,10	0,31
FR0129202000	MEDIOBANCA INTERNATIONAL ZCP 14/05/2026	20 000 000,000	99,76600	EUR	31/03/2026	19 560 712,58	19 953 200,00		392 487,42	0,64
XS3087766385	NATWEST MARKETS NV ZCP 01/06/2026	35 000 000,000	99,63790	EUR	31/03/2026	34 289 259,84	34 873 265,00		584 005,16	1,11
XS3274467201	NATWEST MARKETS NV ZCP 12/01/2027	15 000 000,000	97,94060	EUR	31/03/2026	14 666 340,75	14 691 090,00		24 749,25	0,47
XS3303516838	NTT FINANCE UK LIMi ZCP 20/05/2026	30 000 000,000	99,69090	EUR	31/03/2026	29 839 340,02	29 907 270,00		67 929,98	0,95
XS3320683777	NTT FINANCE UK LIMi ZCP 24/04/2026	9 000 000,000	99,85350	EUR	31/03/2026	8 976 854,68	8 986 815,00		9 960,32	0,29
XS3305112065	NTT FINANCE UK LIMITED ZCP 18/05/2026	55 000 000,000	99,70330	EUR	31/03/2026	54 718 337,36	54 836 815,00		118 477,64	1,75
XS3317639261	NTT FINANCE UK LTD ZCP 15/04/2026	24 000 000,000	99,91020	EUR	31/03/2026	23 949 008,57	23 978 448,00		29 439,43	0,76
XS3219260372	OP CORPORATE BANK P ZCP 23/10/2026	30 000 000,000	98,62830	EUR	31/03/2026	29 370 428,55	29 588 490,00		218 061,45	0,94
FR0129548006	RTE RESEAU DE TRANSP ELECTRI ZCP 08/04/2026	20 000 000,000	99,95380	EUR	31/03/2026	19 894 806,21	19 990 760,00		95 953,79	0,64
XS3298732184	SANTANDER CONSUMER FIN ZCP 11/02/2027	20 000 000,000	97,67940	EUR	31/03/2026	19 560 922,49	19 535 880,00		-25 042,49	0,62
XS3299470412	SANTANDER CONSUMER ZCP 11/12/2026	15 000 000,000	98,15000	EUR	31/03/2026	14 730 276,37	14 722 500,00		-7 776,37	0,47
XS3219325175	SANTANDER CONSUMER ZCP 24/04/2026	50 000 000,000	99,86240	EUR	31/03/2026	49 469 793,74	49 931 200,00		461 406,26	1,59
FR0129655405	SAVENCIA SA ZCP 09/04/2026	10 000 000,000	99,94400	EUR	31/03/2026	9 981 091,40	9 994 400,00		13 308,60	0,32
FR0129673572	SAVENCIA SA ZCP 14/04/2026	20 000 000,000	99,91290	EUR	31/03/2026	19 967 984,66	19 982 580,00		14 595,34	0,64

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
FR0129672517	SAVENCIA SA ZCP 16/04/2026	40 000 000,000	99,90060	EUR	31/03/2026	39 923 679,23	39 960 240,00		36 560,77	1,27
FR0129571768	SEB SA ZCP 16/04/2026	10 000 000,000	99,90410	EUR	31/03/2026	9 947 359,82	9 990 410,00		43 050,18	0,32
FR0129575561	SEB SA ZCP 22/04/2026	20 000 000,000	99,86810	EUR	31/03/2026	19 894 311,47	19 973 620,00		79 308,53	0,64
FR0129653376	SONEPAR SA ZCP 03/06/2026	30 000 000,000	99,61340	EUR	31/03/2026	29 837 584,20	29 884 020,00		46 435,80	0,95
BE6369225113	SUMITOMO MITSUI BAN ZCP 11/05/2026	20 000 000,000	99,76720	EUR	31/03/2026	19 856 667,95	19 953 440,00		96 772,05	0,64
XS3288981957	SVENSKA HANDELSBANKEN AB ZCP 29/01/2027	15 000 000,000	97,78260	EUR	31/03/2026	14 672 142,82	14 667 390,00		-4 752,82	0,47
FR0129063246	SVENSKA HANDELSBANKEN AB ZCP 29/04/2026	5 000 000,000	99,83420	EUR	31/03/2026	4 899 409,01	4 991 710,00		92 300,99	0,16
FR0129582765	TELEPERFORMANCE SE ZCP 04/05/2026	7 400 000,000	99,78980	EUR	31/03/2026	7 373 014,77	7 384 445,20		11 430,43	0,24
FR0129354819	TELEPERFORMANCE SE ZCP 13/04/2026	7 500 000,000	99,91960	EUR	31/03/2026	7 488 507,22	7 493 970,00		5 462,78	0,24
FR0129487114	UNEDIC SA ZCP 06/11/2026	10 000 000,000	98,48230	EUR	31/03/2026	9 783 847,63	9 848 230,00		64 382,37	0,31
FR0129655710	UNION FINANCES GRAI ZCP 10/04/2026	10 000 000,000	99,94140	EUR	31/03/2026	9 981 863,51	9 994 140,00		12 276,49	0,32
FR0129655124	UNION FINANCES GRAINS ZCP 09/04/2026	10 000 000,000	99,94720	EUR	31/03/2026	9 982 489,05	9 994 720,00		12 230,95	0,32
FR0129628154	UNIVERSAL MUSIC GROUP NV ZCP 22/04/2026	10 000 000,000	99,86810	EUR	31/03/2026	9 964 134,65	9 986 810,00		22 675,35	0,32
FR0129628071	UNIVERSAL MUSIC GROUP ZCP 10/06/2026	5 000 000,000	99,56220	EUR	31/03/2026	4 975 433,80	4 978 110,00		2 676,20	0,16
FR0129628394	UNIVERSAL MUSIC GROUP ZCP 13/05/2026	20 000 000,000	99,74020	EUR	31/03/2026	19 914 379,23	19 948 040,00		33 660,77	0,64
FR0129673499	VEOLIA ENVIRONNEMENT ZCP 01/06/2026	20 000 000,000	99,62390	EUR	31/03/2026	19 909 147,92	19 924 780,00		15 632,08	0,63
FR0129672830	VEOLIA ENVIRONNEMENT ZCP 17/03/2027	15 000 000,000	97,32970	EUR	31/03/2026	14 619 071,66	14 599 455,00		-19 616,66	0,46

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
Total Interets precomptes.						1 519 321 074,65	1 526 153 358,20		6 832 283,55	48,59
Total Creances negociables						2 320 322 542,65	2 336 348 925,83	9 085 709,63	6 940 673,55	74,39
Swap de Taux										
SWAP04691930	2760392012	5 000 000,000	100,01987	EUR	31/03/2026		13 201,73	12 208,00	993,73	
SWAP04693378	2763112602	10 000 000,000	100,01977	EUR	31/03/2026		25 056,15	23 078,75	1 977,40	
SWAP04694974	2767186152	10 000 000,000	100,02373	EUR	31/03/2026		24 421,56	22 048,89	2 372,67	
SWAP04697157	2773749642	20 000 000,000	100,02053	EUR	31/03/2026		31 177,79	27 071,00	4 106,79	
SWAP04703173	2789264662	25 000 000,000	100,00504	EUR	31/03/2026		43 003,73	41 743,47	1 260,26	
SWAP04703737	2789797962	40 000 000,000	100,04769	EUR	31/03/2026		97 597,09	78 520,55	19 076,54	
SWAP04706826	2792185442	35 000 000,000	100,04978	EUR	31/03/2026		82 251,71	64 829,33	17 422,38	
SWAP04713468	2796875442	22 900 000,000	100,03474	EUR	31/03/2026		48 696,13	40 740,25	7 955,88	
SWAP04714381	2798428082	6 300 000,000	100,00527	EUR	31/03/2026		10 647,10	10 315,27	331,83	
SWAP04714382	2798594412	15 000 000,000	100,07723	EUR	31/03/2026		37 272,09	25 688,08	11 584,01	
SWAP04723529	2813842972	15 000 000,000	100,06199	EUR	31/03/2026		27 083,49	17 784,96	9 298,53	
SWAP04780106	2862709242	12 500 000,000	100,12226	EUR	31/03/2026		23 448,76	8 166,08	15 282,68	
SWAP04780461	2863881832	30 000 000,000	100,13206	EUR	31/03/2026		60 354,30	20 737,50	39 616,80	
SWAP04806155	2892744252	20 000 000,000	100,17223	EUR	31/03/2026		43 836,54	9 390,33	34 446,21	
SWAP04806154	2892982772	6 200 000,000	100,00323	EUR	31/03/2026		2 059,72	1 859,25	200,47	
SWAP04817097	2905161052	20 000 000,000	100,13228	EUR	31/03/2026		31 823,87	5 368,00	26 455,87	
SWAP04827611	2922922502	10 000 000,000	100,00107	EUR	31/03/2026		1 430,64	1 323,44	107,20	
SWAP04827610	2923119492	7 800 000,000	100,18516	EUR	31/03/2026		16 643,09	2 200,66	14 442,43	
SWAP04839653	2926581072	9 088 000,000	100,03749	EUR	31/03/2026		6 277,93	2 870,54	3 407,39	
SWAP04839652	2926627552	10 000 000,000	100,23624	EUR	31/03/2026		28 169,69	4 546,11	23 623,58	
SWAP04865040	2935596102	50 000 000,000	100,00413	EUR	31/03/2026		13 411,24	11 345,28	2 065,96	
SWAP04865041	2935657812	30 000 000,000	100,25877	EUR	31/03/2026		91 480,86	13 851,34	77 629,52	
SWAP04866191	2937267372	10 000 000,000	100,04371	EUR	31/03/2026		7 130,46	2 759,86	4 370,60	
SWAP04871431	2943810772	20 000 000,000	100,02175	EUR	31/03/2026		6 890,75	2 540,67	4 350,08	
SWAP04879695	2949187952	10 000 000,000	100,26179	EUR	31/03/2026		28 566,55	2 388,00	26 178,55	
SWAP04881701	2952571562	6 400 000,000	100,03267	EUR	31/03/2026		2 910,03	818,84	2 091,19	
SWAP04884340	2957753962	8 800 000,000	100,05097	EUR	31/03/2026		5 340,65	854,92	4 485,73	
SWAP04892722	2962625832	40 000 000,000	100,27251	EUR	31/03/2026		114 340,25	5 338,09	109 002,16	
SWAP04892725	2962647772	20 000 000,000	100,10335	EUR	31/03/2026		22 854,26	2 183,33	20 670,93	
SWAP04922655	3009856922	9 500 000,000	100,35108	EUR	31/03/2026		33 454,93	102,06	33 352,87	
SWAP04922656	3009858932	15 000 000,000	100,11516	EUR	31/03/2026		17 570,18	296,14	17 274,04	
SWAP04923392	3013661662	20 000 000,000	100,35214	EUR	31/03/2026		70 703,51	275,63	70 427,88	
SWAP04923752	3015607942	15 000 000,000	100,35933	EUR	31/03/2026		54 056,70	157,52	53 899,18	
SWAP04924848	3017270942	20 000 000,000	100,23605	EUR	31/03/2026		47 349,35	139,44	47 209,91	
SWAP04943108	3021967322	8 500 000,000	100,37164	EUR	31/03/2026		31 676,08	86,99	31 589,09	
SWAP04943109	3022014132	20 000 000,000	100,37243	EUR	31/03/2026		74 730,28	243,58	74 486,70	
SWAP04947612	3032560652	12 000 000,000	100,41035	EUR	31/03/2026		49 100,85	-141,67	49 242,52	
SWAP04947611	3033105672	4 000 000,000	100,35539	EUR	31/03/2026		14 186,16	-29,45	14 215,61	
SWAP04976196	3037280862	15 000 000,000	100,40889	EUR	31/03/2026		61 897,56	564,51	61 333,05	
SWAP04986425	3042209452	10 000 000,000	100,41423	EUR	31/03/2026		41 677,87	254,48	41 423,39	
SWAP04987017	3047030172	3 124 000,000	100,40245	EUR	31/03/2026		12 641,91	69,30	12 572,61	
SWAP04987122	3050153122	10 000 000,000	100,42952	EUR	31/03/2026		43 183,60	232,09	42 951,51	
SWAP04987234	3051781772	20 000 000,000	100,43115	EUR	31/03/2026		86 671,68	441,10	86 230,58	
SWAP04987354	3053286692	15 000 000,000	100,30285	EUR	31/03/2026		45 815,92	388,55	45 427,37	
SWAP04987353	3053302732	15 000 000,000	100,43878	EUR	31/03/2026		66 261,52	444,80	65 816,72	

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
SWAP05010383	3089978672	20 000 000,000	100,25719	EUR	31/03/2026		49 230,32	-2 207,07	51 437,39	
SWAP05011031	3094522902	15 000 000,000	100,13514	EUR	31/03/2026		19 029,48	-1 241,31	20 270,79	
SWAP05011029	3094554102	15 000 000,000	100,20913	EUR	31/03/2026		29 829,94	-1 539,23	31 369,17	
SWAP05011030	3095024362	15 000 000,000	100,22721	EUR	31/03/2026		32 604,00	-1 476,94	34 080,94	
SWAP05011166	3099290162	20 000 000,000	100,01144	EUR	31/03/2026		2 019,18	-268,68	2 287,86	
SWAP05011167	3099338312	10 000 000,000	100,02184	EUR	31/03/2026		1 951,49	-232,12	2 183,61	
SWAP05011283	3101407942	10 000 000,000	100,24067	EUR	31/03/2026		23 340,27	-727,21	24 067,48	
SWAP05011324	3103291672	5 000 000,000	100,00344	EUR	31/03/2026		112,25	-59,66	171,91	
SWAP04692497	LCH00142072496	5 000 000,000	100,01013	EUR	31/03/2026		9 510,47	9 003,75	506,72	

Code valeur	Libellé	Quantité	Cours	Dev	Date du cours	Prix de revient	Valeur boursière	Intérêts courus	+/- value	% Actif
Total Swap de Taux							1 865 983,66	467 347,39	1 398 636,27	0,06
Liquidités										
APPELS DE MARGES										
MGBNPEUR	Appel de marge EUR	-1 865 983,660	1,00000	EUR	31/03/2026	-1 865 983,66	-1 865 983,66			-0,06
Total APPELS DE MARGES						-1 865 983,66	-1 865 983,66			-0,06
AUTRES										
RMF065EUR	Prov com mvts EUR	-1 476,430	1,00000	EUR	31/03/2026	-1 476,43	-1 476,43			
Total AUTRES						-1 476,43	-1 476,43			
BANQUE OU ATTENTE										
BK065EUR	Banque EUR SGP	247 136 413,970	1,00000	EUR	31/03/2026	247 136 413,97	247 574 408,69	437 994,72		7,88
BK065USD	Banque USD SGP	86,390	0,87218	USD	31/03/2026	79,82	75,35		-4,47	
Total BANQUE OU ATTENTE						247 136 493,79	247 574 484,04	437 994,72	-4,47	7,88
DEPOSIT DE GARANTIE										
DFPBNPEUR	Deposit OTC Verse	1 185 807,780	1,00000	EUR	31/03/2026	1 185 807,78	1 185 807,78			0,04
Total DEPOSIT DE GARANTIE						1 185 807,78	1 185 807,78			0,04
FRAIS DE GESTION										
F110EUR	PrComGestFin	-219 183,910	1,00000	EUR	31/03/2026	-219 183,91	-219 183,91			-0,01
F170EURCP	PrComVariable	-8 437,200	1,00000	EUR	31/03/2026	-8 437,20	-8 437,20			
F171EURCP	PrComVariableAcqu	-5 618,150	1,00000	EUR	31/03/2026	-5 618,15	-5 618,15			
F110EUR-	PrN-1ComGestFin	-1 931,980	1,00000	EUR	31/03/2026	-1 931,98	-1 931,98			
Total FRAIS DE GESTION						-235 171,24	-235 171,24			-0,01
Total Liquidités						246 219 670,24	246 657 660,49	437 994,72	-4,47	7,85

▼ Cours des devises utilisées

Devise	Date du cours	Cours utilisé	Cours inverse
EUR/USD	30/03/2026	1,14655000	0,87218176