

 Dominicé  
US Equities Plus

 Dominicé  
European Equities Plus

# 2022

Rapport annuel au 31.12

Fonds ombrelle contractuel de droit suisse, relevant du type « autres  
fonds en placements traditionnels »

**DOMINICÉ**

**Direction de fonds****Conseil d'administration**

Michel Dominicé  
Michel Abt  
Arno Kneubühler  
Nathalie Feingold

**Direction**

Andreea Stefanescu  
Steven Wicki  
Violaine Augustin-Moreau

**Banque dépositaire****Gestionnaire****Société d'audit****Offices de dépôt****Contrepartie des contrats OTC****Solutions & Funds SA**

Promenade de Castellane 4  
1110 Morges

Président  
Vice-président  
Administrateur  
Administratrice

Direction générale  
Membre de la direction  
Membre de la direction

**UBS Switzerland SA**

Bahnhofstrasse 45  
8098 Zürich

**Dominicé & Co. – Asset Management**

Rue de la Confédération 5  
1204 Genève

**PricewaterhouseCoopers SA**

Avenue Giuseppe-Motta 50  
1202 Genève

SIS SegalInterSettle, Cedel, Euroclear

UBS Switzerland SA

## **Dominicé - US Equities Plus**

---

## **Revue des marchés**

La hausse de l'inflation et la nécessité pour la Fed de relever ses taux d'intérêt après des années de politique monétaire très expansive a mis un terme à la grande hausse boursière de ces dernières années. Pour la première fois depuis 2008, le S&P500 a bouclé l'année en baisse significative avec un recul de 19.4%. Le déclenchement de la guerre en Ukraine a évidemment contribué à la mauvaise performance de la bourse ainsi que la politique « zero Covid » menée par la Chine qui a à la fois réduit la consommation dans ce pays et créé des problèmes logistiques à beaucoup d'entreprises. Les titres les plus en vue les années précédentes ont typiquement connu des parcours particulièrement mauvais avec par exemple Apple, Microsoft, Google, Amazon et Meta en baisse de respectivement 26.8%, 28.7%, 38.7%, 49.6% et 64.2%. A partir d'octobre, le marché a commencé à se redresser à partir du moment où les chiffres de l'inflation ont commencé à refluer et où les investisseurs ont nourri l'espoir d'une fin prochaine de la hausse des taux d'intérêt.

## **Politique d'investissement**

Le fonds a poursuivi son approche basée sur trois instruments : tout d'abord, une grande partie du portefeuille est placée dans des titres appartenant à l'indice de référence, le Standard & Poor's 500 selon une sélection d'actions basée sur un processus quantitatif saisonnier et sur un filtrage ESG. Deuxièmement nous avons appliqué notre stratégie liées à la volatilité des marchés. Cette approche consiste à profiter d'un comportement irrationnel que nous nommons la myopie, c'est-à-dire une perception du risque de la part des investisseurs qui se focalisent à tort sur la volatilité à court terme de la bourse. Enfin, nous avons cherché à profiter des turbulences des marchés pour ajuster notre exposition nette à l'indice à l'aide de futures.

## **Analyse de la performance**

La performance sur l'année du fonds s'établit à -17.29% pour la classe A et à -16.86% pour la classe B (compte tenu du dividende versé en avril). Le fonds a eu un début d'année difficile en raison de la guerre en Ukraine déclenchée en plein hiver, prenant notre stratégie saisonnière à revers car elle attend des mois plutôt positifs en début d'année. Les fluctuations saisonnières ainsi que la rotation sectorielle se sont ensuite remises en phase avec un point bas en octobre, en conformité avec la tendance historique sur laquelle se base notre modèle saisonnier. Le fonds a pu alors rattraper le retard accumulé et a bouclé l'année certes en baisse, mais en surperformance de 1.2% et 1.6% par rapport à l'indice de référence. La stratégie de volatilité a permis aussi de dégager de la surperformance principalement au deuxième semestre.

## **Perspectives et stratégie**

L'année 2023 démarre dans une ambiance optimiste, les marchés saluent le ralentissement de l'inflation et la fin de la politique zéro Covid en Chine. Rien n'est réglé en revanche du côté de l'Ukraine mais le monde semble s'en accommoder. Cette situation est favorable à court terme pour le fonds qui peut profiter d'une embellie hivernale sur les titres cycliques et d'une progression du marché dans son ensemble. La bourse américaine étant cependant déjà chère avec un multiple prix sur bénéfices attendu supérieur à 18 fois pour l'ensemble de l'indice, nous pensons que les perspectives à moyen terme sont plus modestes que par le passé et que notre stratégie quantitative est particulièrement adéquate dans cet environnement.

# Rapport annuel

## Dominice - US Equities Plus

### Chiffres clés

<b>Dominicé - US Equities Plus A</b>	<b>31.12.2022</b>	<b>31.12.2021</b>	<b>31.12.2020</b>
Fortune nette du fonds Mio. USD	9.24	14.52	12.01
Parts en circulation	32'724.000	42'526.000	44'147.000
Valeur nette d'inventaire par part USD	282.41	341.46	272.13
Distribution du revenu net par part	0.00	0.00	0.00
Performance	-17.29%	25.48%	18.28%
S&P 500 net Total Return Index	-18.51%	28.16%	17.75%
TER sans performance fees	1.55%	1.55%	1.56%
TER avec performance fees	1.55%	2.28%	1.69%
 <b>Dominicé - US Equities Plus B</b>	 <b>31.12.2022</b>	 <b>31.12.2021</b>	 <b>31.12.2020</b>
Fortune nette du fonds Mio. USD	130.95	157.93	135.78
Parts en circulation	450.000	451.000	488.000
Valeur nette d'inventaire par part USD	291'004.00	350'175.00	278'230.00
Distribution du revenu net par part	201.74	127.51	392.81
Performance	-16.86%	26.01%	18.73%
S&P 500 net Total Return Index	-18.51%	28.16%	17.75%
TER sans performance fees	1.06%	1.05%	1.08%
TER avec performance fees	1.06%	1.85%	1.31%

Les références aux performances passées ne sauraient être un indicateur de performance courante ou future.

Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais qui peuvent être perçus lors de la souscription et du rachat de parts et sont calculées en considérant que le dividende brut payé a été immédiatement réinvesti dans la part.

# Rapport annuel

## Dominice - US Equities Plus

### Compte de fortune

	31.12.2022 USD	31.12.2021 USD
Avoirs en banque, y compris les placements fiduciaires auprès de banques tierces, divisés en:		
Avoirs à vue	30'318'634.60	21'899'746.92
Valeurs mobilières, divisés en:		
Actions et autres titres de participation et droits-valeurs	115'789'750.98	150'870'305.60
Instruments financiers dérivés	-661'010.00	0.00
Autres actifs	166'858.00	148'385.65
<b>Fortune totale du fonds, dont à déduire</b>	<b>145'614'233.58</b>	<b>172'918'438.17</b>
Engagements en banque	-5'032'553.99	0.00
Autres engagements	-388'509.69	-468'932.63
<b>Fortune nette du fonds</b>	<b>140'193'169.90</b>	<b>172'449'505.54</b>

<b>Nombre de parts en circulation (Dominicé - US Equities Plus A)</b>	<b>Nombre</b>	<b>Nombre</b>
Situation en début d'exercice	42'526.000	44'147.000
Nombre de parts émises	0.000	3'383.000
Nombres de parts rachetées	-9'802.000	-5'004.000
Situation à la fin de l'exercice	32'724.000	42'526.000

<b>Nombre de parts en circulation (Dominicé - US Equities Plus B)</b>	<b>Nombre</b>	<b>Nombre</b>
Situation en début d'exercice	451.000	488.000
Nombre de parts émises	0.000	0.000
Nombres de parts rachetées	-1.000	-37.000
Situation à la fin de l'exercice	450.000	451.000

<b>Variation de la fortune nette du fonds</b>		
Fortune nette du fonds au début de l'exercice	172'449'505.54	147'790'149.74
Distributions	-57'507.01	-185'013.51
Solde des mouvements de parts	-3'469'264.11	-11'009'373.29
Résultat total	-28'729'564.52	35'853'742.60
<b>Fortune nette du fonds à la fin de l'exercice</b>	<b>140'193'169.90</b>	<b>172'449'505.54</b>

# Rapport annuel

## Dominice - US Equities Plus

### Compte de résultat

	01.01.2022 - 31.12.2022 USD	01.01.2021 - 31.12.2021 USD
<b>Revenus</b>		
Produits des avoirs en banque	236'895.30	0.00
Produits des valeurs mobilières, divisés en :		
- Actions et autres titres de participation et droits-valeurs, y compris les produits des actions gratuites	1'429'457.16	1'412'659.80
- Obligations, obligations convertibles, emprunts à option et autres titres de créance et droits-valeurs	0.00	5'791.44
Participation des souscripteurs aux revenus nets courus	0.00	-4'259.25
<b>Total des revenus</b>	<b>1'666'352.46</b>	<b>1'414'191.99</b>
<b>Charges</b>		
Intérêts négatifs sur avoirs en banque	-4'712.28	-24'017.69
Intérêts passifs	-354.61	-13'267.52
Frais d'audit	-15'384.51	-17'295.88
Rémunération réglementaires versées :		
à la direction et au gestionnaire	-1'510'133.62	-1'688'874.87
à la banque dépositaire	-63'410.82	-65'255.85
commissions sur distribution	0.00	-925.07
Autres charges	-16'718.83	-1'517.26
Transfert partiel de charges aux gains de capital réalisé Classe A	6'924.29	7'288.63
Participation des porteurs de parts sortants aux revenus nets courus	9'406.00	12'341.85
<b>Total des charges</b>	<b>-1'594'384.38</b>	<b>-1'791'523.66</b>
<b>Résultat net</b>	<b>71'968.08</b>	<b>-377'331.67</b>
Gains et pertes en capitaux réalisés	-12'134'905.09	43'046'603.06
Commissions de performance	0.00	-1'272'667.88
Transfert partiel de charges aux gains de capital réalisé Classe A	-6'924.29	-7'288.63
<b>Résultat réalisé</b>	<b>-12'069'861.30</b>	<b>41'389'314.88</b>
Gains et pertes en capitaux non réalisés	-16'659'703.22	-5'535'572.28
<b>Résultat total</b>	<b>-28'729'564.52</b>	<b>35'853'742.60</b>
<b>Résultat net par classe</b>		
Résultat net classe "A"	-33'079.80	-85'665.87
Résultat net classe "B"	105'047.90	-291'665.80
<b>Utilisation du résultat classe "A"</b>		
Perte nette	-33'079.80	-85'665.87
Virement au compte gain / perte en capital accumulé	33'079.80	85'665.87
Report de l'année précédente	11'384.09	11'384.09
Résultat disponible pour être réparti	11'384.09	11'384.09
Distribution	0.00	0.00
<b>Report à nouveau</b>	<b>11'384.09</b>	<b>11'384.09</b>
<b>Utilisation du résultat classe "B"</b>		
Revenu net	105'047.90	-291'665.80
Virement au compte gain / perte en capital accumulé	0.00	291'665.80
Report de l'année précédente	24'643.31	82'150.32
Résultat disponible pour être réparti	129'691.21	82'150.32
Distribution	-90'783.85	-57'507.01
<b>Report à nouveau</b>	<b>38'907.36</b>	<b>24'643.31</b>

# Rapport annuel

## Dominice - US Equities Plus

### Inventaire de la fortune au 31.12.2022

Dénomination	Monnaie	Nom./Qté 31.12.2022	Achats / Entrées dans la période de référence	Ventes / Sorties	Cours	Valeur vénale en USD	% de la fortune totale
<b>Valeurs mobilières</b>	<b>USD</b>					<b>115'789'750.98</b>	<b>79.52</b>
<b>Valeurs mobilières négociées en bourse</b>	<b>USD</b>					<b>115'789'750.98</b>	<b>79.52</b>
<b>Actions et autres titres de participation et droits-valeurs</b>	<b>USD</b>					<b>115'789'750.98</b>	<b>79.52</b>
<b>États-Unis</b>	<b>USD</b>					<b>115'789'750.98</b>	<b>79.52</b>
Estee Lauder Rg-A	USD	5943.00	5943	5'403	248.110	1'474'517.73	1.01
Marriott Intl Rg-A	USD	12'200.00	12'200	14'827	148.890	1'816'458.00	1.25
Mastercard Rg-A	USD	7'190.00	7'190		347.730	2'500'178.70	1.72
Meta Platforms Rg-A	USD	3'551.00		5'380	120.340	427'327.34	0.29
MSCI Rg-A	USD	1'618.00	1'618	3'860	465.170	752'645.06	0.52
Berkshire Hath Rg-B	USD	15'492.00	15'492		308.900	4'785'478.80	3.29
Alphab Rg-C-NV	USD	26'525.00	54'610	29'608	88.730	2'353'563.25	1.62
Adobe Rg	USD	1'242.00			336.530	417'970.26	0.29
Advanced Micro D Rg	USD	20'594.00	20'594		64.770	1'333'873.38	0.92
Akamai Technology Rg	USD	24'153.00	24'153		84.300	2'036'097.90	1.40
Allstate Rg	USD	1'877.00	1'877	18'688	135.600	254'521.20	0.17
Amazon.Com Rg	USD	35'408.00	50'580	16'901	84.000	2'974'272.00	2.04
AmerisourceBerge Rg	USD	13'563.00	13'563		165.710	2'247'524.73	1.54
Apple Rg	USD	50'114.00	44'102	25'486	129.930	6'511'312.02	4.47
Applied Material Rg	USD	19'846.00	19'846	22'048	97.380	1'932'603.48	1.33
AT&T Rg	USD	57'989.00	57'989	134'741	18.410	1'067'577.49	0.73
Bank of America Rg	USD	12'419.00	12'419		33.120	411'317.28	0.28
Baxter Intl Rg	USD	40'096.00	40'096	29'937	50.970	2'043'693.12	1.40
Becton Dickinson Rg	USD	4'607.00	4'607		254.300	1'171'560.10	0.80
Boston Scientifi Rg	USD	33'021.00	33'021	83'406	46.270	1'527'881.67	1.05
Cardinal Health Rg	USD	16'629.00	16'629		76.870	1'278'271.23	0.88
CarMax Rg	USD	11'309.00	11'309		60.890	688'605.01	0.47
Caterpillar Rg	USD	9'216.00	9'216	6'031	239.560	2'207'784.96	1.52
Charles Schwab Rg	USD	11'181.00	11'181	13'491	83.280	930'930.06	0.64
Chevron Rg	USD	12'337.00	12'337	7'511	179.490	2'214'368.13	1.52
Cisco Systems Rg	USD	90'408.00	90'408	22'011	47.640	4'307'037.12	2.96
CSX Rg	USD	79'910.00	79'910		30.980	2'475'611.80	1.70
Deere & Co Rg	USD	4'249.00	4'249	1'937	428.760	1'821'801.24	1.25
Digit Realty REIT Rg	USD	17'574.00	17'574	12'146	100.270	1'762'144.98	1.21
Dollar Tree Rg	USD	5'683.00	5'683		141.440	803'803.52	0.55
Eli Lilly & Co Rg	USD	6'111.00	6'111	7'982	365.840	2'235'648.24	1.54
Enphase Energy Rg	USD	1'904.00	1'904		264.960	504'483.84	0.35
Equifax Inc Rg	USD	11'122.00	11'122	7'146	194.360	2'161'671.92	1.48
Exelon Rg	USD	92'692.00	92'692		43.230	4'007'075.16	2.75
Exxon Mobil Rg	USD	14'853.00	14'853	31'593	110.300	1'638'285.90	1.13
Fastenal Rg	USD	50'419.00	50'419		47.320	2'385'827.08	1.64
FMC Corp Rg	USD	10'591.00	10'591		124.800	1'321'756.80	0.91
Fortinet Rg	USD	18'260.00	18'260	5'700	48.890	892'731.40	0.61
Freeport McMoRan Rg	USD	27'359.00	27'359	38'295	38.000	1'039'642.00	0.71
Generac Hldgs Rg	USD	2'074.00	2'074		100.660	208'768.84	0.14
Global Payments Rg	USD	5'675.00	5'675		99.320	563'641.00	0.39
Hess Rg	USD	5'645.00	5'645		141.820	800'573.90	0.55
Host Hotels REIT Rg	USD	42'770.00	42'770		16.050	686'458.50	0.47
HP Rg	USD	34'274.00	34'274	19'294	26.870	920'942.38	0.63
IBM Rg	USD	24'009.00	24'009	18'088	140.890	3'382'628.01	2.32
Illumina Rg	USD	1'943.00	1'943	6'981	202.200	392'874.60	0.27
Intel Rg	USD	33'887.00	33'887	25'587	26.430	895'633.41	0.62
Intl Flavors&Fra Rg	USD	17'731.00	17'731	3'885	104.840	1'858'918.04	1.28
Kroger Rg	USD	21'578.00	21'578	12'991	44.580	961'947.24	0.66
Live Nation Ent Rg	USD	4'450.00	4'450		69.740	310'343.00	0.21
M&T Bank Rg	USD	5'643.00	5'643		145.060	818'573.58	0.56
Mckesson Rg	USD	3'490.00	3'490	5'859	375.120	1'309'168.80	0.90
Merck Rg	USD	6'934.00	6'934		110.950	769'327.30	0.53
Micron Technolog Rg	USD	16'523.00	16'523	9'656	49.980	825'819.54	0.57
Microsoft Rg	USD	20'557.00			239.820	4'929'979.74	3.39
Moody's Rg	USD	8'557.00	8'557	11'069	278.620	2'384'151.34	1.64
Mosaic Rg	USD	10'063.00	10'063		43.870	441'463.81	0.30
Newmont Rg	USD	14'681.00	14'681	13'023	47.200	692'943.20	0.48
Northern Trust Rg	USD	19'005.00	19'005		88.490	1'681'752.45	1.15
NVIDIA Rg	USD	2'078.00			146.140	303'678.92	0.21
Occid.Petrol Cor Rg	USD	5'451.00	5'451	21'300	62.990	343'358.49	0.24
PG&E Rg	USD	51'072.00	51'072		16.260	830'430.72	0.57
Pool Rg	USD	2'837.00	2'837		302.330	857'710.21	0.59
Publ Svcs Enterp Rg	USD	32'573.00	32'573		61.270	1'995'747.71	1.37
Southwest Airlin Rg	USD	18'526.00	18'526		33.670	623'770.42	0.43
SVB Financial Gr Rg	USD	3'553.00	3'553	2'916	230.140	817'687.42	0.56
Teradyne Rg	USD	13'794.00	13'794		87.350	1'204'905.90	0.83
Tesla Rg	USD	6'249.00	6'249	2'083	123.180	769'751.82	0.53
Trimble Rg	USD	12'379.00	12'379		50.560	625'882.24	0.43
Union Pacific Rg	USD	3'621.00	3'621	2'983	207.070	749'800.47	0.51
United Rentals Rg	USD	2'226.00	2'226	6'192	355.420	791'164.92	0.54
Valero Energy Rg	USD	9'966.00	9'966	4'274	126.860	1'264'286.76	0.87
Verizon Comm Rg	USD	12'008.00	63'545	51'537	39.400	473'115.20	0.32
Vertex Pharmaceu Rg	USD	6'442.00	6'442		288.780	1'860'320.76	1.28
Walt Disney Rg	USD	17'220.00	17'220	33'550	86.890	1'496'073.60	1.03
Weyerhaeuser REI Rg	USD	23'765.00	23'765		31.000	736'715.00	0.51
Yum Brands Rg	USD	13'944.00	13'944	14'686	128.080	1'785'947.52	1.23
Zebra Tech -A-	USD	2'752.00	2'752	3'456	256.410	705'640.32	0.48
<b>Produits dérivés</b>	<b>USD</b>					<b>-661'010.00</b>	<b>-0.45</b>
Future on index ES MAR23 March 2023 Mini	USD	9'550.00	191		3'861.000	0.00	0.00
Future on index ES MAR23 March 2023 Mini	USD	-5'000.00	363	463	3'861.000	0.00	0.00
Future on index ES MAR23 March 2023 Mini	USD	-4'750.00	136	231	3'861.000	0.00	0.00
Future on index VX APR23 April 2023	USD	-8'000.00		8	25.875	0.00	0.00
Future on index VX FEB23 February 2023	USD	-84'000.00	36	120	24.545	0.00	0.00
Future on index VX JAN23 January 2023	USD	-163'000.00	464	627	23.098	0.00	0.00
Future on index VX MAR23 March 2023	USD	-33'000.00	8	41	25.351	0.00	0.00
Option on index SPX C E 3900 JAN23 Call 3900 January 2023	USD	-1'000.00		10	50.700	-50'700.00	-0.03
Option on index SPX C E 4000 JAN23 Call 4000 January 2023	USD	1'000.00	10		18.100	18'100.00	0.01
Option on index SPX C E 4050 MAR23 Call 4050 March 2023	USD	1'000.00	10		68.700	68'700.00	0.05
Option on index SPX C E 4100 JAN23 Call 4100 January 2023	USD	1'000.00	10		4.400	4'400.00	0.00
Option on index SPX C E 4300 JAN23 Call 4300 January 2023	USD	1'000.00	10		0.350	350.00	0.00



# Rapport annuel

## Dominice - US Equities Plus

### Inventaire de la fortune au 31.12.2022

Dénomination	Monnaie	Nom./Qté 31.12.2022	Achats / Entrées dans la période de référence	Ventes / Sorties	Cours	Valeur vénale en USD	% de la fortune totale
Option on index SPX P E 3600 FEB23 Put 3600 February 2023	USD	-1'000.00		10	40.200	-40'200.00	-0.03
Option on index SPX P E 3600 JAN23 Put 3600 January 2023	USD	-500.00		5	11.700	-5'850.00	0.00
Option on index SPX P E 3600 MAR23 Put 3600 March 2023	USD	-2'000.00		20	66.500	-133'000.00	-0.09
Option on index SPX P E 3700 FEB23 Put 3700 February 2023	USD	-1'000.00		10	63.700	-63'700.00	-0.04
Option on index SPX P E 3700 JAN23 Put 3700 January 2023	USD	-1'000.00		10	26.000	-26'000.00	-0.02
Option on index SPX P E 3700 MAR23 Put 3700 March 2023	USD	-1'000.00		10	92.780	-92'780.00	-0.06
Option on index SPX P E 3800 FEB23 Put 3800 February 2023	USD	-1'000.00		10	96.200	-96'200.00	-0.07
Option on index SPX P E 3800 JAN23 Put 3800 January 2023	USD	-1'000.00		10	53.700	-53'700.00	-0.04
Option on index SPX P E 4000 FEB23 Put 4000 February 2023	USD	-500.00		5	199.300	-99'650.00	-0.07
Option on index SPXW C E 3900 JAN23 Call 3900 January 2023	USD	1'000.00	10		7.400	7'400.00	0.01
Option on index SPXW C E 3950 JAN23 Call 3950 January 2023	USD	1'000.00	10		1.000	1'000.00	0.00
Option on index SPXW P E 3700 JAN23 Put 3700 January 2023	USD	-1'000.00		10	6.400	-6'400.00	0.00
Option on index SPXW P E 3700 JAN23 Put 3700 January 2023	USD	-1'000.00		10	19.400	-19'400.00	-0.01
Option on index SPXW P E 3750 JAN23 Put 3750 January 2023	USD	-500.00		5	15.600	-7'800.00	-0.01
Option on index SPXW P E 3800 JAN23 Put 3800 January 2023	USD	-1'000.00		10	27.400	-27'400.00	-0.02
Option on index SPXW P E 3800 JAN23 Put 3800 January 2023	USD	-500.00		5	11.700	-5'850.00	0.00
Option on index SPXW P E 3825 JAN23 Put 3825 January 2023	USD	-1'000.00		10	32.330	-32'330.00	-0.02
<b>Avoirs à vue</b>	<b>USD</b>	<b>30'318'634.60</b>				<b>30'318'634.60</b>	<b>20.82</b>
Compte courant ordinaire	USD	353'262.93				353'262.93	0.24
Compte courant ETD	USD	29'965'371.67				29'965'371.67	20.58
<b>Autres actifs</b>	<b>USD</b>	<b>166'858.00</b>				<b>166'858.00</b>	<b>0.11</b>
<b>Fortune totale du fonds</b>	<b>USD</b>					<b>145'614'233.58</b>	<b>100.00</b>
Engagements en banque	USD	-5'032'553.99				-5'032'553.99	-3.46
<b>Autres engagements</b>	<b>USD</b>	<b>-388'509.69</b>				<b>-388'509.69</b>	<b>-0.27</b>
<b>Fortune nette du fonds</b>					<b>USD</b>	<b>140'193'169.90</b>	<b>96.28 *)</b>

#### Catégories d'évaluation (art. 84, al. 2, OPC-FINMA)

	Valeur vénale en USD	% de la fortune totale
a. Placements cotés en bourse ou négociés sur un autre marché réglementé ouvert au public	115'128'740.98	79.07
b. Placements pour lesquels aucun cours selon la let. a n'est disponible, évalués selon des paramètres observables sur le marché	0.00	0.00
c. Placements qui, en raison de paramètres non observables sur le marché, sont évalués au moyen de modèles d'évaluation appropriés en tenant compte des conditions actuelles du marché	0.00	0.00

#### Note concernant la présentation des futures

Dans l'inventaire de la fortune ainsi que dans le compte de fortune, les futures sont affichés avec une valeur de zéro.

Les plus- ou moins-values latentes sur futures sont calculées et enregistrées quotidiennement et font l'objet d'un règlement journalier via la réception / le paiement d'un montant en espèces correspondant à l'augmentation / la diminution journalière de la valeur de marché de chaque contrat future via le compte de marge.

Ce montant en espèces est comptabilisé sous le poste "Avoirs à vue" du compte de fortune et le montant correspondant est comptabilisé sous le poste "Gains et pertes en capitaux réalisés" du compte de résultat.

Pour cette raison, les futures n'ont pas de gains/pertes non réalisés à la clôture et figure donc à zéro dans le compte de fortune et dans l'inventaire.

# Rapport annuel

## Dominice - US Equities Plus

Les transactions conclues au cours de la période de référence n'apparaissant plus dans l'inventaire au 31.12.2022

Dénomination	Monnaie	Achats	Ventes
<b>Valeurs mobilières</b>			
<b>Actions</b>			
NXP Semiconducto Br	USD		3'500
Chubb N	USD	6'831	6'831
Charter Comm Rg-A	USD	4'036	4'036
Lennar Rg-A	USD		8'791
SBA Cmms REIT-A Rg	USD	4'864	4'864
Utd Parcel Svc Rg-B	USD	11'074	11'074
Activision Blizz Rg	USD	10'867	10'867
Amer Tower REIT Rg	USD	4'036	4'036
American Intl Gr Rg	USD	21'630	21'630
Amgen Rg	USD	5'589	5'589
Analog Devices Rg	USD		5'379
Ansys Rg	USD		5'535
Anthem Rg	USD		3'497
Autodesk Inc Rg	USD		5'157
Automatic Data P Rg	USD	3'622	3'622
Best Buy Rg	USD	3'105	3'105
Biogen Rg	USD	8'526	8'526
Blackrock Rg	USD		4'629
Brdridg Fncl Sol Rg	USD	21'320	21'320
CF Industries HI Rg	USD	14'386	14'386
Chipotle Mexican Rg	USD		813
Cintas Rg	USD	6'417	6'417
Citigroup Rg	USD	81'760	81'760
Colgate-Palmoliv Rg	USD		24'282
Copart Rg	USD		3'084
Costco Whsl Rg	USD	2'173	2'173
CVS Health Rg	USD		22'255
D R Horton Rg	USD		13'732
Danaher Rg	USD	2'380	2'380
Devon Energy Rg	USD		24'633
Discover Fncl Sr Rg	USD	6'520	6'520
eBay Rg	USD		11'381
Electronic Arts Rg	USD	6'934	6'934
Equinix REIT Rg	USD		4'316
Expedia Group Rg	USD	6'313	6'313
Expedit Intl Was Rg	USD	8'486	8'486
Fedex Rg	USD	4'864	4'864
General Mills Rg	USD		9'253
General Motors Rg	USD	81'048	81'048
Gilead Sciences Rg	USD	40'466	40'466
Goldman Sachs Gr Rg	USD	2'794	2'794
Hologic Rg	USD	40'363	40'363
Intuit Rg	USD	1'966	1'966
Johnson Ctr Int Rg	USD	74'308	74'308
JPMorgan Chase Rg	USD	22'562	22'562
Kimberly-Clark Rg	USD		16'023
Lowe's Com Rg	USD	6'520	6'520
Medtronic Rg	USD	23'390	23'390
Microchip Tech Rg	USD		9'188
Morgan Stanley Rg	USD	5'071	5'071
Motorola Soltn Rg	USD	1'759	1'759
NetApp Rg	USD	9'625	9'625
Netflix Rg	USD		3'099
NextEra Energy Rg	USD	7'762	7'762
Norfolk Southern Rg	USD		10'782
ONEOK Rg	USD	8'590	8'590
Paccar Rg	USD		14'628
Paychex Inc Rg	USD	22'562	22'562
Paycom Software Rg	USD		924
PayPal Holdings Rg	USD		10'149
PerkinElmer Rg	USD	5'899	5'899
Philip Mrrs Int Rg	USD		4'010
PNC Finl Ser Rg	USD		8'225
Procter&Gamble Rg	USD	34'981	34'981
Progressive (Ohi Rg	USD		5'295
Qualcomm Rg	USD	13'247	13'247
Regeneron Pharma Rg	USD	3'415	3'415
Resmed Rg	USD	7'452	7'452
Salesforce Rg	USD	9'728	9'728
ServiceNow Rg	USD		1'481
Sherwin-Williams Rg	USD		837
Skyworks Solutio Rg	USD		2'326
Starbucks Rg	USD		15'975
STERIS Rg	USD	7'555	7'555
Synopsys Rg	USD	2'380	2'380
T Rowe Price Grp Rg	USD		9'862
T-Mobile US Rg	USD	5'071	5'071
Take-Two Interac Rg	USD	9'935	9'935
Thermo Fisher Sc Rg	USD	1'552	1'552

# Rapport annuel

## Dominice - US Equities Plus

### Les transactions conclues au cours de la période de référence n'apparaissant plus dans l'inventaire au 31.12.2022

Dénomination	Monnaie	Achats	Ventes
TransDigm Rg	USD	3'105	3'105
Tyler Technologi Rg	USD	2'277	2'277
US Bancorp Rg	USD	81'760	81'760
Verisk Analytics Rg	USD		11'969
Walgreens Boots Rg	USD		22'652
Warnr Bros Rg-A	USD	32'596	32'596
Wells Fargo Rg	USD		10'358
West Pharmaceuti Rg	USD	1'759	1'759
Williams Compani Rg	USD	121'605	121'605
Zimmer Biomet HI Rg	USD		15'700
ZimVie Rg	USD	1'570	1'570
Comcast-A	USD	29'703	29'703
Nike -B-	USD	4'657	4'657

### Produits dérivés

#### Options d'achat

Option on index SPX C E 3975 DEC22 Call 3975 December 2022	USD	5	5
Option on index SPX C E 4000 DEC22 Call 4000 December 2022	USD	13	13
Option on index SPX C E 4025 DEC22 Call 4025 December 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 3625 SEP22 Call 3625 September 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 3650 OCT22 Call 3650 October 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 3650 SEP22 Call 3650 September 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 3675 OCT22 Call 3675 October 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 3675 SEP22 Call 3675 September 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 3700 OCT22 Call 3700 October 2022	USD	55	55
Option on index SPXW C E 3725 OCT22 Call 3725 October 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 3750 OCT22 Call 3750 October 2022	USD	45	45
Option on index SPXW C E 3750 SEP22 Call 3750 September 2022	USD	25	25
Option on index SPXW C E 3770 NOV22 Call 3770 November 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 3775 OCT22 Call 3775 October 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 3775 SEP22 Call 3775 September 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 3800 OCT22 Call 3800 October 2022	USD	56	56
Option on index SPXW C E 3825 DEC22 Call 3825 December 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 3825 NOV22 Call 3825 November 2022	USD	25	25
Option on index SPXW C E 3825 OCT22 Call 3825 October 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 3825 SEP22 Call 3825 September 2022	USD	20	20
Option on index SPXW C E 3850 NOV22 Call 3850 November 2022	USD	35	35
Option on index SPXW C E 3850 OCT22 Call 3850 October 2022	USD	15	15
Option on index SPXW C E 3850 SEP22 Call 3850 September 2022	USD	20	20
Option on index SPXW C E 3875 JUL22 Call 3875 July 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 3875 SEP22 Call 3875 September 2022	USD	35	35
Option on index SPXW C E 3880 OCT22 Call 3880 October 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 3900 DEC22 Call 3900 December 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 3900 JUL22 Call 3900 July 2022	USD	9	9
Option on index SPXW C E 3900 OCT22 Call 3900 October 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 3900 SEP22 Call 3900 September 2022	USD	35	35
Option on index SPXW C E 3920 DEC22 Call 3920 December 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 3925 DEC22 Call 3925 December 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 3925 SEP22 Call 3925 September 2022	USD	30	30
Option on index SPXW C E 3945 DEC22 Call 3945 December 2022	USD	2	2
Option on index SPXW C E 3950 DEC22 Call 3950 December 2022	USD	2	2
Option on index SPXW C E 3950 JUL22 Call 3950 July 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 3950 SEP22 Call 3950 September 2022	USD	40	40
Option on index SPXW C E 3955 DEC22 Call 3955 December 2022	USD	2	2
Option on index SPXW C E 3960 DEC22 Call 3960 December 2022	USD	2	2
Option on index SPXW C E 3975 AUG22 Call 3975 August 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 3975 DEC22 Call 3975 December 2022	USD	7	7
Option on index SPXW C E 3975 JUL22 Call 3975 July 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 3975 NOV22 Call 3975 November 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 3975 SEP22 Call 3975 September 2022	USD	40	40
Option on index SPXW C E 3980 DEC22 Call 3980 December 2022	USD	2	2
Option on index SPXW C E 3985 DEC22 Call 3985 December 2022	USD	2	2
Option on index SPXW C E 3990 DEC22 Call 3990 December 2022	USD	2	2
Option on index SPXW C E 4000 DEC22 Call 4000 December 2022	USD	14	14
Option on index SPXW C E 4000 NOV22 Call 4000 November 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 4000 OCT22 Call 4000 October 2022	USD	15	15
Option on index SPXW C E 4000 SEP22 Call 4000 September 2022	USD	35	35
Option on index SPXW C E 4010 DEC22 Call 4010 December 2022	USD	4	4
Option on index SPXW C E 4015 DEC22 Call 4015 December 2022	USD	4	4
Option on index SPXW C E 4025 DEC22 Call 4025 December 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 4025 SEP22 Call 4025 September 2022	USD	30	30
Option on index SPXW C E 4040 DEC22 Call 4040 December 2022	USD	2	2
Option on index SPXW C E 4050 AUG22 Call 4050 August 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 4050 JUL22 Call 4050 July 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 4050 SEP22 Call 4050 September 2022	USD	15	15
Option on index SPXW C E 4075 DEC22 Call 4075 December 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 4075 JUL22 Call 4075 July 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 4075 SEP22 Call 4075 September 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 4100 DEC22 Call 4100 December 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 4100 SEP22 Call 4100 September 2022	USD	25	25
Option on index SPXW C E 4125 AUG22 Call 4125 August 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 4125 DEC22 Call 4125 December 2022	USD	10	10

# Rapport annuel

## Dominice - US Equities Plus

### Les transactions conclues au cours de la période de référence n'apparaissant plus dans l'inventaire au 31.12.2022

Dénomination	Monnaie	Achats	Ventes
Option on index SPXW C E 4150 AUG22 Call 4150 August 2022	USD	20	20
Option on index SPXW C E 4150 DEC22 Call 4150 December 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 4150 SEP22 Call 4150 September 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 4175 AUG22 Call 4175 August 2022	USD	20	20
Option on index SPXW C E 4200 DEC22 Call 4200 December 2022	USD	5	5
Option on index SPXW C E 4225 AUG22 Call 4225 August 2022	USD	15	15
Option on index SPXW C E 4250 AUG22 Call 4250 August 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 4250 SEP22 Call 4250 September 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 4275 AUG22 Call 4275 August 2022	USD	10	10
Option on index SPXW C E 4300 AUG22 Call 4300 August 2022	USD	10	10
Option on index VIX C E 32.5 SEP22 Call 32.5 September 2022	USD	37	37
Option on index VIX C E 35 OCT22 Call 35 October 2022	USD	148	148
Option on index VIX C E 35 SEP22 Call 35 September 2022	USD	37	37
Option on index VIX C E 37.5 SEP22 Call 37.5 September 2022	USD	37	37
Option on index VIX C E 40 OCT22 Call 40 October 2022	USD	148	148
Option on index VIX C E 40 SEP22 Call 40 September 2022	USD	37	37
Option on index VIX C E 45 OCT22 Call 45 October 2022	USD	148	148
Option on index VIX C E 45 SEP22 Call 45 September 2022	USD	259	259
Option on index VIX C E 50 OCT22 Call 50 October 2022	USD	148	148
Option on index VIX C E 60 OCT22 Call 60 October 2022	USD	148	148
Option on index VIX C E 65 OCT22 Call 65 October 2022	USD	148	148
<b>Options de vente</b>			
Option on index SPXW P E 3250 JUN22 Put 3250 June 2022	USD	1	1
Option on index SPXW P E 3250 OCT22 Put 3250 October 2022	USD	56	56
Option on index SPXW P E 3275 OCT22 Put 3275 October 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3290 OCT22 Put 3290 October 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3300 OCT22 Put 3300 October 2022	USD	167	167
Option on index SPXW P E 3300 SEP22 Put 3300 September 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3325 OCT22 Put 3325 October 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3345 OCT22 Put 3345 October 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3350 OCT22 Put 3350 October 2022	USD	130	130
Option on index SPXW P E 3350 SEP22 Put 3350 September 2022	USD	56	56
Option on index SPXW P E 3370 OCT22 Put 3370 October 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3400 NOV22 Put 3400 November 2022	USD	37	37
Option on index SPXW P E 3400 OCT22 Put 3400 October 2022	USD	240	240
Option on index SPXW P E 3400 SEP22 Put 3400 September 2022	USD	108	108
Option on index SPXW P E 3405 OCT22 Put 3405 October 2022	USD	56	56
Option on index SPXW P E 3410 OCT22 Put 3410 October 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3425 NOV22 Put 3425 November 2022	USD	148	148
Option on index SPXW P E 3425 SEP22 Put 3425 September 2022	USD	56	56
Option on index SPXW P E 3450 OCT22 Put 3450 October 2022	USD	37	37
Option on index SPXW P E 3450 SEP22 Put 3450 September 2022	USD	185	185
Option on index SPXW P E 3470 NOV22 Put 3470 November 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3475 OCT22 Put 3475 October 2022	USD	37	37
Option on index SPXW P E 3500 JUL22 Put 3500 July 2022	USD	1	1
Option on index SPXW P E 3500 NOV22 Put 3500 November 2022	USD	130	130
Option on index SPXW P E 3500 OCT22 Put 3500 October 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3500 SEP22 Put 3500 September 2022	USD	167	167
Option on index SPXW P E 3520 OCT22 Put 3520 October 2022	USD	56	56
Option on index SPXW P E 3525 SEP22 Put 3525 September 2022	USD	111	111
Option on index SPXW P E 3540 SEP22 Put 3540 September 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3550 NOV22 Put 3550 November 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3550 OCT22 Put 3550 October 2022	USD	154	154
Option on index SPXW P E 3565 NOV22 Put 3565 November 2022	USD	37	37
Option on index SPXW P E 3575 SEP22 Put 3575 September 2022	USD	111	111
Option on index SPXW P E 3590 OCT22 Put 3590 October 2022	USD	37	37
Option on index SPXW P E 3600 JUL22 Put 3600 July 2022	USD	37	37
Option on index SPXW P E 3600 NOV22 Put 3600 November 2022	USD	195	195
Option on index SPXW P E 3600 OCT22 Put 3600 October 2022	USD	99	99
Option on index SPXW P E 3615 DEC22 Put 3615 December 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3615 NOV22 Put 3615 November 2022	USD	56	56
Option on index SPXW P E 3625 JUL22 Put 3625 July 2022	USD	37	37
Option on index SPXW P E 3625 NOV22 Put 3625 November 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3625 OCT22 Put 3625 October 2022	USD	5	5
Option on index SPXW P E 3630 NOV22 Put 3630 November 2022	USD	112	112
Option on index SPXW P E 3640 JUL22 Put 3640 July 2022	USD	37	37
Option on index SPXW P E 3640 NOV22 Put 3640 November 2022	USD	5	5
Option on index SPXW P E 3650 DEC22 Put 3650 December 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3650 OCT22 Put 3650 October 2022	USD	20	20
Option on index SPXW P E 3675 SEP22 Put 3675 September 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3680 SEP22 Put 3680 September 2022	USD	56	56
Option on index SPXW P E 3700 DEC22 Put 3700 December 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3700 NOV22 Put 3700 November 2022	USD	130	130
Option on index SPXW P E 3700 OCT22 Put 3700 October 2022	USD	10	10
Option on index SPXW P E 3700 SEP22 Put 3700 September 2022	USD	9	9
Option on index SPXW P E 3705 SEP22 Put 3705 September 2022	USD	37	37
Option on index SPXW P E 3720 DEC22 Put 3720 December 2022	USD	37	37
Option on index SPXW P E 3750 JUL22 Put 3750 July 2022	USD	30	30
Option on index SPXW P E 3750 SEP22 Put 3750 September 2022	USD	24	24
Option on index SPXW P E 3760 SEP22 Put 3760 September 2022	USD	74	74
Option on index SPXW P E 3765 NOV22 Put 3765 November 2022	USD	37	37
Option on index SPXW P E 3775 DEC22 Put 3775 December 2022	USD	15	15

# Rapport annuel

## Dominice - US Equities Plus

### Les transactions conclues au cours de la période de référence n'apparaissant plus dans l'inventaire au 31.12.2022

Dénomination	Monnaie	Achats	Ventes
Option on index SPXW P E 3790 SEP22 Put 3790 September 2022	USD	65	65
Option on index SPXW P E 3800 DEC22 Put 3800 December 2022	USD	18	18
Option on index SPXW P E 3800 JUL22 Put 3800 July 2022	USD	5	5
Option on index SPXW P E 3800 NOV22 Put 3800 November 2022	USD	10	10
Option on index SPXW P E 3800 OCT22 Put 3800 October 2022	USD	15	15
Option on index SPXW P E 3825 JUL22 Put 3825 July 2022	USD	18	18
Option on index SPXW P E 3850 JUL22 Put 3850 July 2022	USD	10	10
Option on index SPXW P E 3850 NOV22 Put 3850 November 2022	USD	30	30
Option on index SPXW P E 3850 SEP22 Put 3850 September 2022	USD	2	2
Option on index SPXW P E 3875 JUL22 Put 3875 July 2022	USD	10	10
Option on index SPXW P E 3885 NOV22 Put 3885 November 2022	USD	37	37
Option on index SPXW P E 3900 DEC22 Put 3900 December 2022	USD	7	7
Option on index SPXW P E 3900 JUL22 Put 3900 July 2022	USD	20	20
Option on index SPXW P E 3900 NOV22 Put 3900 November 2022	USD	20	20
Option on index SPXW P E 3900 SEP22 Put 3900 September 2022	USD	15	15
Option on index SPXW P E 3910 NOV22 Put 3910 November 2022	USD	15	15
Option on index SPXW P E 3925 NOV22 Put 3925 November 2022	USD	12	12
Option on index SPXW P E 3940 DEC22 Put 3940 December 2022	USD	2	2
Option on index SPXW P E 3950 AUG22 Put 3950 August 2022	USD	10	10
Option on index SPXW P E 3950 DEC22 Put 3950 December 2022	USD	5	5
Option on index SPXW P E 3950 JUL22 Put 3950 July 2022	USD	20	20
Option on index SPXW P E 3950 SEP22 Put 3950 September 2022	USD	15	15
Option on index SPXW P E 3975 AUG22 Put 3975 August 2022	USD	10	10
Option on index SPXW P E 3975 SEP22 Put 3975 September 2022	USD	10	10
Option on index SPXW P E 3990 DEC22 Put 3990 December 2022	USD	2	2
Option on index SPXW P E 3990 NOV22 Put 3990 November 2022	USD	2	2
Option on index SPXW P E 4000 AUG22 Put 4000 August 2022	USD	121	121
Option on index SPXW P E 4000 JUL22 Put 4000 July 2022	USD	10	10
Option on index SPXW P E 4000 NOV22 Put 4000 November 2022	USD	12	12
Option on index SPXW P E 4010 NOV22 Put 4010 November 2022	USD	2	2
Option on index SPXW P E 4025 AUG22 Put 4025 August 2022	USD	10	10
Option on index SPXW P E 4040 NOV22 Put 4040 November 2022	USD	2	2
Option on index SPXW P E 4050 AUG22 Put 4050 August 2022	USD	25	25
Option on index SPXW P E 4050 DEC22 Put 4050 December 2022	USD	5	5
Option on index SPXW P E 4060 AUG22 Put 4060 August 2022	USD	9	9
Option on index SPXW P E 4075 AUG22 Put 4075 August 2022	USD	19	19
Option on index SPXW P E 4125 AUG22 Put 4125 August 2022	USD	20	20
Option on index SPXW P E 4150 AUG22 Put 4150 August 2022	USD	10	10
Option on index SPXW P E 4200 AUG22 Put 4200 August 2022	USD	20	20
Option on index SPXW P E 4225 AUG22 Put 4225 August 2022	USD	10	10
Option on index SPXW P E 4250 AUG22 Put 4250 August 2022	USD	10	10
Option on index VIX P E 23 SEP22 Put 23 September 2022	USD	111	111
<b>Futures</b>			
Future on index ES DEC22 December 2022 Mini	USD	5'321	5'321
Future on index ES MAR22 March 2022 Mini	USD	538	531
Future on index ES JUN22 June 2022 Mini	USD	1'859	1'859
Future on index ES SEP22 September 2022 Mini	USD	3'137	3'137
Future on index VX APR22 April 2022	USD	841	841
Future on index VX AUG22 August 2022	USD	959	959
Future on index VX DEC22 December 2022	USD	773	773
Future on index VX FEB22 February 2022	USD	631	506
Future on index VX JAN22 January 2022	USD	276	28
Future on index VX JUL22 July 2022	USD	1'334	1'334
Future on index VX JUN22 June 2022	USD	1'127	1'127
Future on index VX MAR22 March 2022	USD	955	955
Future on index VX MAY22 May 2022	USD	1'133	1'133
Future on index VX NOV22 November 2022	USD	1'062	1'062
Future on index VX OCT22 October 2022	USD	1'152	1'152
Future on index VX SEP22 September 2022	USD	893	893

#### Notes à propos des listes d'achats / ventes

Les achats englobent entre autres les transactions suivantes :

achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions / en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions / droits de souscription et d'options / ouvertures sur swaps.

Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes :

ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés / clôture swaps / échéances sur swaps.

# Rapport annuel

## Dominice - US Equities Plus

### Instruments financiers dérivés - Commitment II

Description de l'instrument	Monnaie	Taux de change	Positions long	Positions short	Quantité	Prix du sous-jacent	Delta	Taille du contrat	Exposition brute en EUR	Exposition brute en % de la VNI
<b>Futures</b>										
UXF3 INDEX	USD	1.00000	464	-627	-163	21.67		1000	23'641'970.00	16.86%
UXG3 INDEX	USD	1.00000	36	-120	-84	21.67		1000	3'380'520.00	2.41%
UXH3 INDEX	USD	1.00000	8	-41	-33	21.67		1000	1'061'830.00	0.76%
UXJ3 INDEX	USD	1.00000		-8	-8	21.67		1000	173'360.00	0.12%
ESH3 INDEX	USD	1.00000	136	-231	-95	3'839.50		50	70'454'825.00	50.26%
ESH3 INDEX	USD	1.00000	191		191	3'839.50		50	36'667'225.00	26.15%
ESH3 INDEX	USD	1.00000	363	-463	-100	3'839.50		50	158'571'350.00	113.11%
<b>Options</b>										
SPX US 01/20/23 C4100 INDEX	USD	1.00000	10		10	3'839.50	0.0670	100	257'246.50	0.18%
SPX US 01/20/23 C3900 INDEX	USD	1.00000		-10	-10	3'839.50	0.4030	100	1'547'318.50	1.10%
SPX US 01/20/23 C4000 INDEX	USD	1.00000	10		10	3'839.50	0.1980	100	760'221.00	0.54%
SPX US 01/20/23 C4300 INDEX	USD	1.00000	10		10	3'839.50	0.0070	100	26'876.50	0.02%
SPX US 01/20/23 P3700 INDEX	USD	1.00000		-10	-10	3'839.50	-0.2160	100	829'332.00	0.59%
SPX US 01/20/23 P3600 INDEX	USD	1.00000		-5	-5	3'839.50	-0.1080	100	207'333.00	0.15%
SPX US 01/20/23 P3800 INDEX	USD	1.00000		-10	-10	3'839.50	-0.3850	100	1'478'207.50	1.05%
SPX US 02/17/23 P3700 INDEX	USD	1.00000		-10	-10	3'839.50	-0.2920	100	1'121'134.00	0.80%
SPX US 02/17/23 P3800 INDEX	USD	1.00000		-10	-10	3'839.50	-0.4050	100	1'554'997.50	1.11%
SPX US 02/17/23 P4000 INDEX	USD	1.00000		-5	-5	3'839.50	-0.6710	100	1'288'152.25	0.92%
SPX US 02/17/23 P3600 INDEX	USD	1.00000		-10	-10	3'839.50	-0.2000	100	767'900.00	0.55%
SPX US 03/17/23 C4050 INDEX	USD	1.00000	10		10	3'839.50	0.3220	100	1'236'319.00	0.88%
SPX US 03/17/23 P3600 INDEX	USD	1.00000		-20	-20	3'839.50	-0.2420	100	1'858'318.00	1.33%
SPX US 03/17/23 P3700 INDEX	USD	1.00000		-10	-10	3'839.50	-0.3190	100	1'224'800.50	0.87%
SPXW US 01/04/23 C3950 INDEX	USD	1.00000	10		10	3'839.50	0.0440	100	168'938.00	0.12%
SPXW US 01/04/23 C3900 INDEX	USD	1.00000	10		10	3'839.50	0.2050	100	787'097.50	0.56%
SPXW US 01/09/23 P3800 INDEX	USD	1.00000		-10	-10	3'839.50	-0.3370	100	1'293'911.50	0.92%
SPXW US 01/09/23 P3700 INDEX	USD	1.00000		-10	-10	3'839.50	-0.1050	100	403'147.50	0.29%
SPXW US 01/06/23 P3825 INDEX	USD	1.00000		-10	-10	3'839.50	-0.4120	100	1'581'874.00	1.13%
SPXW US 01/13/23 P3700 INDEX	USD	1.00000		-10	-10	3'839.50	-0.1900	100	729'505.00	0.52%
SPXW US 01/10/23 P3750 INDEX	USD	1.00000		-5	-5	3'839.50	-0.2130	100	408'906.75	0.29%
SPXW US 01/04/23 P3800 INDEX	USD	1.00000		-5	-5	3'839.50	-0.2550	100	489'536.25	0.35%
<b>Engagement total brut issu de dérivés</b>									<b>313'972'152.75</b>	<b>223.96%</b>
<b>Compensation</b>									<b>291'572'657.00</b>	<b>207.98%</b>
<b>Engagement total net issu de dérivés</b>									<b>22'399'495.75</b>	<b>15.98%</b>
<b>VNI</b>									<b>140'193'169.90</b>	

### Rémunérations et frais à la charge de l'investisseur :

(extrait du § 18 du contrat de fonds)

#### Classes «A» et «B»

Commission d'émission en faveur de la direction du fonds, de la banque dépositaire, et/ou des distributeurs en Suisse et à l'étranger

Taux maximum (pa)	Taux effectif (pa)
1.00%	0%
de la valeur nette d'inventaire des parts	de la valeur nette d'inventaire des parts

Commission de rachat en faveur du compartiment et/ou des distributeurs en Suisse et à l'étranger

Taux maximum (pa)	Taux effectif (pa)
0.50%	0%
de la valeur nette d'inventaire	de la valeur nette d'inventaire

#### Rémunérations et frais à la charge de la fortune du compartiment :

(extrait du § 19 du contrat de fonds)

#### Classe «A»

Commission de gestion de la direction du fonds (calculée sur la valeur nette d'inventaire de la classe) utilisée pour la direction, l'Asset Management et la commercialisation de la classe

Taux maximum (pa)	Taux effectif (pa)
1.50%	1.50%

#### Classe «B»

Commission de gestion de la direction du fonds (calculée sur la valeur nette d'inventaire de la classe) utilisée pour la direction, l'Asset Management et la commercialisation de la classe

Taux maximum (pa)	Taux effectif (pa)
1.00%	1.00%

#### Classes «A» et «B»

Commission de la banque dépositaire (calculée sur la valeur nette d'inventaire du fonds)

Taux maximum (pa)	Taux effectif (pa)
18'000 CHF + 0.05% (minimum 25'000 CHF)	18'000 CHF + 0.03%

Commission de la banque dépositaire pour le versement du produit annuel aux investisseurs (calculée sur la valeur nette d'inventaire du compartiment)

Taux maximum (pa)	Taux effectif (pa)
0.50%	0.50%

# Rapport annuel

## Dominice - US Equities Plus

En supplément, les autres rémunérations et frais accessoires énumérés dans le § 19 du contrat de fonds peuvent être facturés au compartiment.

### Accords de rétrocessions de commissions (« commission sharing agreements ») et commissions en nature (« soft commissions »)

La direction du fonds n'a pas conclu d'accords de rétrocessions de commissions (« commission sharing agreements »).

La direction du fonds n'a pas conclu des accords concernant des « soft commissions ».

### Principes d'évaluation

Les placements négociés en bourse ou sur un autre marché réglementé ouvert au public doivent être évalués selon les cours du marché principal. D'autres placements ou les placements pour lesquels aucun cours du jour n'est disponible doivent être évalués au prix qui pourrait en être obtenu s'ils étaient vendus avec soin au moment de l'évaluation. Pour la détermination de la valeur vénale, la direction du fonds utilise dans ce cas des modèles et principes d'évaluation appropriés et reconnus dans la pratique.

Les avoirs en banque sont évalués à la valeur nominale et les intérêts courus sont, cas échéant, pris en compte. En cas de changements notables des conditions du marché ou de la solvabilité, la base d'évaluation des avoirs en banque à terme est adaptée aux nouvelles circonstances.

La valeur des instruments du marché monétaire qui ne sont pas négociés à une bourse ou sur un marché réglementé ouvert au public est déterminée de la manière suivante :

le prix d'évaluation de tels placements est adapté successivement au prix de rachat, en partant du prix net d'acquisition, avec maintien constant du rendement de placement jusqu'à l'échéance. En cas de changements notables des conditions du marché, la base d'évaluation des différents placements est adaptée aux nouveaux rendements du marché. En cas de prix actuel manquant du marché, on se réfère normalement à l'évaluation d'instruments du marché monétaire présentant des caractéristiques identiques (qualité et siège de l'émetteur, monnaie d'émission, durée).

La valeur des contrats à terme (contrats futures et forwards) et des contrats d'options négociés sur une bourse de valeurs ou un autre marché réglementé doit être déterminée sur la base du prix de clôture ou de règlement publié par la bourse de valeurs ou l'autre marché réglementé qui constitue en règle générale le principal lieu de négociation de ces contrats. Les contrats à terme et d'options qui ne sont pas négociés sur une bourse de valeurs ou un autre marché réglementé (dérivé conclu OTC) sont évalués au moyen de modèles d'évaluation appropriés et reconnus par la pratique, sur la base de la valeur vénale des sous-jacents.

La valeur nette d'inventaire du fonds et la quote-part des différentes classes est déterminée à la valeur vénale.

## Dominicé - European Equities Plus

---



## **Revue des marchés**

L'année 2022 a été difficile pour les actions européennes en raison de la politique de hausse des taux d'intérêt menée par les grandes banques centrales en réaction au réveil de l'inflation. Le climat économique européen s'est aussi dégradé en raison du déclenchement de la guerre en Ukraine à fin février 2022 ce qui a entraîné une hausse significative du prix de l'énergie en Europe. Enfin, la politique « zéro Covid » menée par la Chine jusqu'au mois de décembre a contribué à créer des perturbations dans les chaînes logistiques industrielles. La baisse de l'euro et de la livre britannique de 6% et 11% par rapport au dollar ont sans doute permis de modérer les baisses des bourses en monnaie locales, l'indice britannique a même fini l'année en légère hausse. Mesurée en Euro, notre indice de référence a cependant baissé de 8.8% et notre fonds a baissé de 10.9%.

## **Politique d'investissement**

Le fonds a poursuivi son approche basée sur trois instruments : tout d'abord, une grande partie du portefeuille est placée dans des titres appartenant à l'univers d'investissement, les actions européennes sans la Suisse. La sélection d'actions est basée sur un processus quantitatif saisonnier et sur un filtrage ESG. Deuxièmement nous avons appliqué notre stratégie liées à la volatilité des marchés. Cette approche consiste à profiter d'un comportement irrationnel que nous nommons la myopie, c'est-à-dire une perception du risque de la part des investisseurs qui se focalisent à tort sur la volatilité à court terme de la Bourse. Enfin, nous avons cherché à profiter des turbulences des marchés pour ajuster notre exposition nette à l'aide de futures.

## **Analyse de la performance**

Notre approche a mal fonctionné en début de période. Les effets attendus de la saisonnalité étant perturbés par le déclenchement de la guerre en Ukraine qui a fortement pesé sur la cote et les titres cycliques précisément pendant la période qui est historiquement la plus favorable. Un été difficile encore et un mois d'octobre où le marché a trouvé son point bas de l'année a permis à notre approche de rétablir la situation et à redresser la situation tant par rapport au marché qu'en termes absolus.

Notre stratégie de volatilité n'a pas pu contribuer à la performance du fonds. En effet, tandis que notre approche permet généralement de profiter de flambée de volatilité, une telle action ne s'est pas produite comme on aurait pu s'y attendre en octobre, lorsque les plus bas de l'année ont été atteints.

## **Perspectives et stratégie**

L'année 2023 commence avec beaucoup d'espoir que la vague mondiale d'inflation est en train de refluer, que les hausses de taux des banques centrales vont rapidement s'arrêter et que la fin de la politique « zéro Covid » en Chine va faciliter le travail de l'industrie et relancer la demande globale. La guerre en Ukraine continue, mais il semble que le monde économique s'en soit accommodé. En l'absence de nouvelles perturbations exogènes, les marchés financiers reprennent leur comportement cyclique influencé par le rythme des années calendaires ce qui devrait permettre à notre approche de profiter pleinement d'une embellie boursière particulièrement sensible sur l'Europe.

# Rapport annuel

## Dominicé - European Equities Plus

### Chiffres clés

<b>Dominicé - European Equities Plus A</b>	<b>31.12.2022</b>	<b>31.12.2021</b>	<b>Depuis le lancement du fonds au 29.09.2020</b>
Fortune nette du fonds Mio. EUR	25.47	28.37	
Parts en circulation	207'850.000	206'310.000	
Valeur nette d'inventaire par part EUR	122.54	137.52	
Distribution du revenu net par part	2.43	0.00	
Performance	-10.89%	22.62%	22.54%
MSCI Europe ex Switzerland Net Return EUR Index	-8.83%	24.53%	27.16%
TER sans performance fees	1.24%	1.19%	
TER avec performance fees	1.24%	1.66%	

Les références aux performances passées ne sauraient être un indicateur de performance courante ou future.

Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais qui peuvent être perçus lors de la souscription et du rachat de parts et sont calculées en considérant que le dividende brut payé a été immédiatement réinvesti dans la part.

# Rapport annuel

## Dominicé - European Equities Plus

### Compte de fortune

	31.12.2022 EUR	31.12.2021 EUR
Avoirs en banque, y compris les placements fiduciaires auprès de banques tierces, divisés en:		
Avoirs à vue	4'552'738.63	3'948'145.98
Valeurs mobilières, divisés en:		
Actions et autres titres de participation et droits-valeurs	21'168'384.30	24'705'110.02
Instruments financiers dérivés	-86'093.58	-15'171.92
Autres actifs	65'326.88	23'627.02
<b>Fortune totale du fonds, dont à déduire</b>	<b>25'700'356.23</b>	<b>28'661'711.10</b>
Engagements en banque	-145'401.37	-193'238.46
Autres engagements	-84'759.96	-95'742.89
<b>Fortune nette du fonds</b>	<b>25'470'194.90</b>	<b>28'372'729.75</b>

### Nombre de parts en circulation (Dominicé - European Equities Plus A)

	Nombre	Nombre
Situation en début d'exercice	206'310.000	0.000
Nombre de parts émises	3'250.000	206'310.000
Nombres de parts rachetées	-1'710.000	0.000
Situation à la fin de l'exercice	207'850.000	206'310.000

### Variation de la fortune nette du fonds

Fortune nette du fonds au début de l'exercice	28'372'729.75	0.00
Solde des mouvements de parts	220'593.22	21'280'342.24
Résultat total	-3'123'128.07	7'092'387.51
<b>Fortune nette du fonds à la fin de l'exercice</b>	<b>25'470'194.90</b>	<b>28'372'729.75</b>

# Rapport annuel

## Dominicé - European Equities Plus

### Compte de résultat

	01.01.2022 - 31.12.2022	29.09.2020 - 31.12.2021
	EUR	EUR
<b>Revenus</b>		
Produits des avoirs en banque	1'333.75	207.52
Produits des valeurs mobilières, divisés en :		
- Actions et autres titres de participation et droits-valeurs, y compris les produits des actions gratuites	842'288.09	609'822.84
Autres revenus	0.00	55.80
Participation des souscripteurs aux revenus nets courus	-94.57	-8'914.79
<b>Total des revenus</b>	<b>843'527.27</b>	<b>601'171.37</b>
<b>Charges</b>		
Intérêts négatifs sur avoirs en banque	-12'466.73	-14'195.98
Intérêts passifs	0.00	-26'133.35
Frais d'audit	-11'915.93	-19'395.34
Rémunération réglementaires versées :		
à la direction et au gestionnaire	-254'249.49	-297'041.17
à la banque dépositaire	-30'867.62	-35'595.36
Autres charges	-19'637.35	-3'530.81
Participation des porteurs de parts sortants aux revenus nets courus	109.28	0.00
<b>Total des charges</b>	<b>-329'027.84</b>	<b>-395'892.01</b>
<b>Résultat net</b>	<b>514'499.43</b>	<b>205'279.36</b>
Gains et pertes en capitaux réalisés	-1'646'438.98	4'104'093.59
Commission de performance fee	-277.70	-141'853.76
<b>Résultat réalisé</b>	<b>-1'132'217.25</b>	<b>4'167'519.19</b>
Gains et pertes en capitaux non réalisés	-1'990'910.82	2'924'868.32
<b>Résultat total</b>	<b>-3'123'128.07</b>	<b>7'092'387.51</b>
<b>Résultat net par classe</b>		
Résultat net classe "A"	514'499.43	205'279.36
<b>Utilisation du résultat classe "A"</b>		
Revenu net	514'499.43	205'279.36
Report de l'année précédente	205'279.36	0.00
Résultat disponible pour être réparti	719'778.79	205'279.36
Distribution	-505'075.50	0.00
<b>Report à nouveau</b>	<b>214'703.29</b>	<b>205'279.36</b>

# Rapport annuel

## Dominicé - European Equities Plus

### Inventaire de la fortune au 31.12.2022

Dénomination	Monnaie	Nom./Qté 31.12.2022	Achats / Entrées dans la période de référence	Ventes / Sorties dans la période de référence	Cours	Valeur vénale en EUR	% de la fortune totale
<b>Valeurs mobilières</b>	<b>EUR</b>					<b>21'168'384.30</b>	<b>82.37</b>
<b>Valeurs mobilières négociées en bourse</b>	<b>EUR</b>					<b>21'168'384.30</b>	<b>82.37</b>
<b>Actions cotées en bourse</b>	<b>EUR</b>					<b>21'168'384.30</b>	<b>82.37</b>
<b>Allemagne</b>	<b>EUR</b>					<b>2'908'120.17</b>	<b>11.32</b>
Fresenius Medic Br	EUR	13'224.00	13'224	3'440	30.570	404'257.68	1.57
HeidelbergCement I	EUR	6'185.00	6'185	4'957	53.280	329'536.80	1.28
Rheinmetall I	EUR	886.00	886		186.050	164'840.30	0.64
Zalando I	EUR	1'877.00	1'877		33.110	62'147.47	0.24
Bayer N	EUR	5'736.00	7'000	6'272	48.325	277'192.20	1.08
Deutsche Boerse N	EUR	1'534.00	2'500	4'271	161.400	247'587.60	0.96
Dt Lufthansa N	EUR	45'099.00	45'099		7.765	350'193.74	1.36
K+S N	EUR	2'705.00	2'705		18.375	49'704.38	0.19
Vonovia N	EUR	4'592.00	4'592	1'810	22.020	101'115.84	0.39
Allianz Rg	EUR	1'889.00	1'889		200.900	379'500.10	1.48
Sartorius Vz I	EUR	543.00	543	523	369.400	200'584.20	0.78
Volkswagen Vz I	EUR	2'933.00	2'933	1'612	116.420	341'459.86	1.33
<b>Autriche</b>	<b>EUR</b>					<b>232'082.50</b>	<b>0.90</b>
OMV I	EUR	4'825.00	4'825	3'869	48.100	232'082.50	0.90
<b>Belgique</b>	<b>EUR</b>					<b>429'211.52</b>	<b>1.67</b>
KBC Gr	EUR	7'144.00	7'144	3'795	60.080	429'211.52	1.67
<b>Danemark</b>	<b>EUR</b>					<b>1'243'860.34</b>	<b>4.84</b>
Coloplast -B-	DKK	3'471.00	3'471	3'731	812.000	378'911.28	1.47
Novo Nordisk -B-	DKK	6'859.00	6'859	8'530	938.000	864'949.06	3.37
<b>Espagne</b>	<b>EUR</b>					<b>989'657.85</b>	<b>3.85</b>
Grifols-A Br	EUR	15'675.00	2'580		10.770	168'819.75	0.66
Aena Br	EUR	786.00			117.300	92'197.80	0.36
Cellnex Telecom Br	EUR	3'084.00			30.920	95'357.28	0.37
MERLIN Prop. Br	EUR	3'005.00			8.775	26'368.88	0.10
Siem Gam Ren En Br	EUR	10'988.00			18.050	198'333.40	0.77
Banco Santander Rg	EUR	125'884.00	23'123		2.803	352'789.91	1.37
Inmob Colonial	EUR	9'283.00			6.010	55'790.83	0.22
<b>Finlande</b>	<b>EUR</b>					<b>344'080.45</b>	<b>1.34</b>
Stora Enso-R Rg	EUR	8'861.00	8'861	4'282	13.150	116'522.15	0.45
Waertsilae Rg	EUR	28'922.00	28'922	13'305	7.868	227'558.30	0.89
<b>France</b>	<b>EUR</b>					<b>3'758'611.03</b>	<b>14.62</b>
Air Liquide	EUR	1'406.00	1'406	1'093	132.400	186'154.40	0.72
Arkema	EUR	1'269.00	294		83.880	106'443.72	0.41
Capgemini	EUR	581.00			156.950	90'606.96	0.35
Danone	EUR	2'287.00			49.230	112'589.01	0.44
ENGIE	EUR	4'452.00			13.388	59'603.38	0.23
EssilorLuxott	EUR	696.00			169.200	117'763.20	0.46
Kering	EUR	242.00			475.500	115'071.00	0.45
LEGRAND	EUR	1'172.00			74.820	87'689.04	0.34
LVMH	EUR	712.00			679.900	484'088.80	1.88
Orange	EUR	8'654.00			9.281	80'317.77	0.31
Saint-Gobain	EUR	3'160.00	765		45.650	144'254.00	0.56
Sanofi	EUR	3'564.00			89.840	320'189.76	1.25
Schneider El	EUR	1'482.00			130.720	193'727.04	0.75
Societe Generale	EUR	9'521.00	1'891		23.480	223'553.08	0.87
Teleperformance	EUR	348.00			222.700	77'499.60	0.30
Vinci	EUR	1'724.00			93.290	160'831.96	0.63
BNP Paribas A	EUR	5'735.00	1'076		53.250	305'388.75	1.19
AXA	EUR	6'160.00			26.055	160'498.80	0.62
Dassault Syst	EUR	1'716.00			33.495	57'477.42	0.22
Euroapi	EUR	154.00	155	1	13.850	2'132.90	0.01
Hermes Intl	EUR	89.00			1'445.000	128'605.00	0.50
L'Oreal	EUR	802.00			333.600	267'547.20	1.04
Pernod Ricard	EUR	983.00			183.750	180'626.25	0.70
Veolia Environnem	EUR	3'998.00			24.000	95'952.00	0.37
<b>Irlande</b>	<b>EUR</b>					<b>633'572.19</b>	<b>2.47</b>
CRH PLC Rg	EUR	3'241.00			37.010	119'949.41	0.47
Linde Rg	EUR	1'564.00	139		305.450	477'723.80	1.86
DCC Rg	GBP	779.00			40.800	35'898.98	0.14
<b>Italie</b>	<b>EUR</b>					<b>60'369.40</b>	<b>0.23</b>
Amplifon N	EUR	2'170.00			27.820	60'369.40	0.23
<b>Jersey</b>	<b>EUR</b>					<b>615'228.93</b>	<b>2.39</b>
Ferguson Rg	GBP	580.00			104.400	68'393.20	0.27
Wizz Air Rg	GBP	3'635.00	1'382		19.045	78'193.36	0.30
Experian Rg	GBP	2'361.00			28.130	75'015.36	0.29
Glencore Rg	GBP	63'088.00	18'932	13'602	5.524	393'627.01	1.53
<b>Luxembourg</b>	<b>EUR</b>					<b>92'352.24</b>	<b>0.36</b>
Tenaris Rg	EUR	5'671.00	5'671	23'024	16.285	92'352.24	0.36
<b>Norvège</b>	<b>EUR</b>					<b>575'741.78</b>	<b>2.24</b>
Adevinta Rg	NOK	10'885.00	10'885		65.600	67'867.72	0.26
Equinor Rg	NOK	15'189.00	15'189		351.800	507'874.06	1.98
<b>Pays-Bas</b>	<b>EUR</b>					<b>2'410'033.73</b>	<b>9.38</b>
Akzo Nobel Br Rg	EUR	2'141.00	2'141		62.560	133'940.96	0.52
ASML Hldg Br Rg	EUR	838.00	1'040	233	503.800	422'184.40	1.64
Heineken Br Rg	EUR	4'471.00	4'471		87.880	392'911.48	1.53
STMicroelectr Br Rg	EUR	11'302.00	11'302		32.995	372'909.49	1.45
Aalberts Br	EUR	2'158.00	2'158		36.230	78'184.34	0.30
Randstad Br	EUR	3'864.00	3'864		56.960	220'093.44	0.86
Adyen	EUR	116.00	116		1'288.400	149'454.40	0.58
Prosus Rg-N	EUR	2'673.00	2'673		64.450	172'274.85	0.67
Asm Int Rg	EUR	1'177.00	1'177		235.650	277'360.05	1.08
Besi Rg	EUR	3'372.00	3'372		56.560	190'720.32	0.74
<b>Portugal</b>	<b>EUR</b>					<b>562'847.03</b>	<b>2.19</b>

# Rapport annuel

## Dominicé - European Equities Plus

### Inventaire de la fortune au 31.12.2022

Dénomination	Monnaie	Nom./Qté 31.12.2022	Achats / Entrées dans la période de référence	Ventes / Sorties	Cours	Valeur vénale en EUR	% de la fortune totale
Galp Energia -B-	EUR	38'709.00	38'709		12.610	488'120.49	1.90
Jeronimo Martins Rg	EUR	3'703.00	3'703	22'318	20.180	74'726.54	0.29
<b>Royaume-Uni</b>	<b>EUR</b>					<b>3'747'651.72</b>	<b>14.58</b>
3i Group Rg	GBP	5'344.00			13.415	80'973.25	0.32
Antofagasta Rg	GBP	10'046.00	10'046		15.455	175'366.50	0.68
Ashtead Group Rg	GBP	1'538.00			47.200	81'984.14	0.32
Aviva Rg	GBP	12'682.00	12'683	1	4.428	63'427.83	0.25
Barclays Rg	GBP	58'289.00			1.585	100'784.11	0.39
Bunzl Rg	GBP	1'626.00			27.590	50'670.68	0.20
Compass Group Rg	GBP	4'496.00			19.175	97'374.70	0.38
Croda Intl Rg	GBP	749.00			66.040	55'869.31	0.22
Diageo Rg	GBP	4'487.00			36.500	184'983.67	0.72
Halma Rg	GBP	2'575.00			19.740	57'412.81	0.22
Interlek Group Rg	GBP	753.00			40.340	34'309.57	0.13
Investec Rg	GBP	114'627.00	114'627		5.114	662'112.99	2.58
Legal & General Rg	GBP	30'979.00			2.495	87'301.64	0.34
Lloyds Banking G Rg	GBP	178'412.00			0.454	91'508.20	0.36
LSE Group Rg	GBP	724.00			71.360	58'354.97	0.23
Natl Grid Rg	GBP	5'805.00			9.974	65'396.73	0.25
Prudential Rg	GBP	5'913.00			11.275	75'302.41	0.29
Reckitt Benck Gr Rg	GBP	1'406.00			57.540	91'377.58	0.36
RELX Rg	GBP	3'604.00			22.880	93'137.65	0.36
Rio Tinto Rg	GBP	1'784.00			57.980	116'830.85	0.45
Sage Grp Rg	GBP	6'211.00			7.456	52'306.05	0.20
Segro (REIT) Rg	GBP	5'383.00			7.636	46'427.44	0.18
Spirax-Sarco Eng Rg	GBP	394.00			106.150	47'239.00	0.18
Tesco Rg	GBP	29'052.00			2.242	73'569.21	0.29
Unilever Rg	GBP	2'013.00			41.820	95'085.05	0.37
Anglo American Rg	GBP	4'497.00	1'294		32.365	164'392.86	0.64
AstraZeneca Rg	GBP	2'419.00		203	112.180	306'503.73	1.19
BP Rg	GBP	51'336.00	5'659		4.749	275'364.95	1.07
HSBC Hldg Rg	GBP	28'734.00			5.157	167'370.02	0.65
Smith & Nephew Rg	GBP	3'110.00			11.095	38'973.75	0.15
Standard Charter Rg	GBP	12'341.00			6.224	86'756.97	0.34
Vodafone Group Rg	GBP	72'700.00			0.842	69'173.10	0.27
<b>Suède</b>	<b>EUR</b>					<b>2'276'908.24</b>	<b>8.86</b>
Sandvik Br	SEK	13'781.00	13'781	13'879	188.400	233'427.49	0.91
Sv Handtk Rg-A	SEK	39'922.00	39'922	58'500	105.100	377'229.27	1.47
Ericsson-B Rg	SEK	46'095.00	46'095	30'632	60.900	252'383.81	0.98
Volvo -B- Rg	SEK	33'019.00	33'019	22'601	188.480	559'525.09	2.18
EQT Rg	SEK	5'138.00	5'138		220.600	101'903.71	0.40
Skanska -B-	SEK	22'596.00	22'596	32'699	165.000	335'201.45	1.30
SKF -B-	SEK	12'379.00	12'379	11'958	159.150	177'126.11	0.69
Svenska Cellulo -B-	SEK	6'033.00	6'033		131.950	71'570.34	0.28
Trelleborg B	SEK	7'785.00	7'785	12'685	240.800	168'540.97	0.66
<b>Suisse</b>	<b>EUR</b>					<b>288'055.18</b>	<b>1.12</b>
Coca-Cola HBC N	GBP	12'926.00	12'926		19.730	288'055.18	1.12
<b>Produits dérivés</b>	<b>EUR</b>					<b>-85'996.00</b>	<b>-0.33</b>
Future on index FSMI MAR23 March 2023	CHF	-60.00		6	10'656.000	0.00	0.00
Future on index FDAX MAR23 March 2023	EUR	-75.00	13	16	13'988.000	0.00	0.00
Future on index FESX MAR23 March 2023	EUR	390.00	39		3'785.000	0.00	0.00
Future on index FESX MAR23 March 2023	EUR	-920.00	51	143	3'785.000	0.00	0.00
Future on index FESX MAR23 March 2023	EUR	-320.00	100	132	3'785.000	0.00	0.00
Future on index FMEU MAR23 March 2023	EUR	15'500.00	155		267.900	0.00	0.00
Future on index FVS FEB23 February 2023	EUR	-15'500.00		155	22.850	0.00	0.00
Future on index FVS JAN23 January 2023	EUR	-39'400.00	447		21.950	0.00	0.00
Option on index ODAX C E 14200 JAN Call 14200 January 2023	EUR	-15.00		3	118.500	-1'777.50	-0.01
Option on index ODAX P E 13400 JAN Put 13400 January 2023	EUR	-35.00		7	82.600	-2'891.00	-0.01
Option on index ODAX P E 13600 JAN Put 13600 January 2023	EUR	-35.00		7	123.600	-4'326.00	-0.02
Option on index ODAX P E 13800 JAN Put 13800 January 2023	EUR	-30.00		6	183.200	-5'496.00	-0.02
Option on index ODAX P E 14000 JAN Put 14000 January 2023	EUR	-30.00		6	266.500	-7'995.00	-0.03
Option on index ODX1 C E 14100 JAN Call 14100 January 2023	EUR	-30.00		6	54.900	-1'647.00	-0.01
Option on index ODX1 P E 13700 JAN Put 13700 January 2023	EUR	-30.00		6	51.400	-1'542.00	-0.01
Option on index ODX1 P E 13900 JAN Put 13900 January 2023	EUR	-30.00		6	113.700	-3'411.00	-0.01
Option on index ODX2 C E 14200 JAN Call 14200 January 2023	EUR	-15.00		3	83.600	-1'254.00	0.00
Option on index ODX2 P E 13600 JAN Put 13600 January 2023	EUR	-15.00		3	90.400	-1'356.00	-0.01
Option on index ODX2 P E 13900 JAN Put 13900 January 2023	EUR	-15.00		3	183.900	-2'758.50	-0.01
Option on index OES1 C E 3800 JAN23 Call 3800 January 2023	EUR	-20.00		2	25.100	-502.00	0.00
Option on index OES1 C E 3850 JAN23 Call 3850 January 2023	EUR	-90.00		9	10.200	-918.00	0.00
Option on index OES1 C E 3900 JAN23 Call 3900 January 2023	EUR	-70.00		7	3.500	-245.00	0.00
Option on index OES1 P E 3700 JAN23 Put 3700 January 2023	EUR	-70.00		7	8.600	-602.00	0.00
Option on index OES1 P E 3750 JAN23 Put 3750 January 2023	EUR	-90.00		9	21.500	-1'935.00	-0.01
Option on index OES1 P E 3800 JAN23 Put 3800 January 2023	EUR	-90.00		9	45.300	-4'077.00	-0.02
Option on index OES2 C E 3900 JAN23 Call 3900 January 2023	EUR	-70.00		7	13.400	-938.00	0.00
Option on index OES2 P E 3700 JAN23 Put 3700 January 2023	EUR	-70.00		7	26.700	-1'869.00	-0.01
Option on index OES2 P E 3800 JAN23 Put 3800 January 2023	EUR	-70.00		7	65.500	-4'585.00	-0.02
Option on index OESX P E 3650 FEB23 Put 3650 February 2023	EUR	-110.00		11	61.500	-6'765.00	-0.03
Option on index OESX P E 3700 JAN23 Put 3700 January 2023	EUR	-220.00		22	37.300	-8'206.00	-0.03
Option on index OESX P E 3750 FEB23 Put 3750 February 2023	EUR	-220.00		22	95.000	-20'900.00	-0.08
<b>Produits de change à terme</b>	<b>EUR</b>					<b>-97.58</b>	<b>0.00</b>
<b>Positions ouvertes</b>							
FX Forward EUR CHF 24.02.23	Achat EUR	Achat	Vente	Vente	Cours		
		540'720.00	CHF	533'283.48	0.986069	-97.58	0.00
<b>Avoirs à vue</b>	<b>EUR</b>	<b>4'552'738.63</b>				<b>4'552'738.63</b>	<b>17.71</b>
Compte courant ordinaire	CHF	4'100.00				4'156.54	0.02
Compte courant ordinaire	DKK	535'179.24				71'949.23	0.28
Compte courant ordinaire	EUR	1'067'093.18				1'067'093.18	4.15
Compte courant ordinaire	GBP	26'356.27				29'769.29	0.12
Compte courant ordinaire	NOK	461'289.14				43'843.40	0.17
Compte courant ordinaire	PLN	50'829.11				10'856.12	0.04
Compte courant ordinaire	SEK	1'877'175.78				168'770.03	0.66
Compte courant ordinaire	USD	5'079.43				4'750.90	0.02
Compte courant ETD	EUR	3'151'549.94				3'151'549.94	12.26

## Rapport annuel Dominicé - European Equities Plus

### Inventaire de la fortune au 31.12.2022

Dénomination	Monnaie	Nom./Qté 31.12.2022	Achats / Entrées dans la période de référence	Ventes / Sorties de référence	Cours	Valeur vénale en EUR	% de la fortune totale
<b>Autres actifs</b>	EUR	65'326.88				65'326.88	0.25
<b>Fortune totale du fonds</b>	EUR					25'700'356.23	100.00
Engagements en banque	CHF	-85'896.09				-87'080.58	-0.34
Engagements en banque	EUR	-58'320.79				-58'320.79	-0.23
<b>Total engagement en banque</b>		<b>-144'216.88</b>				<b>-145'401.37</b>	
<b>Autres engagements</b>	EUR	<b>-84'759.96</b>				<b>-84'759.96</b>	<b>-0.33</b>
<b>Fortune nette du fonds</b>					<b>EUR</b>	<b>25'470'194.90</b>	<b>99.10 *)</b>

### Catégories d'évaluation (art. 84, al. 2, OPC-FINMA)

Catégories d'évaluation (art. 84, al. 2, OPC-FINMA)	Valeur vénale en EUR	% de la fortune totale
a. Placements cotés en bourse ou négociés sur un autre marché réglementé ouvert au public	21'082'388.30	82.03
b. Placements pour lesquels aucun cours selon la let. a n'est disponible, évalués selon des paramètres observables sur le marché	-97.58	-0.00
c. Placements qui, en raison de paramètres non observables sur le marché, sont évalués au moyen de modèles d'évaluation appropriés en tenant compte des conditions actuelles du marché	0.00	0.00

### Note concernant la présentation des futures

Solufonds SA a modifié la présentation comptable des futures. Dans l'inventaire de la fortune ainsi que dans le compte de fortune, les futures sont affichés avec une valeur de zéro. Les plus- ou moins-values latentes sur futures sont calculées et enregistrées quotidiennement et font l'objet d'un règlement journalier via la réception / le paiement d'un montant en espèces correspondant à l'augmentation / la diminution journalière de la valeur de marché de chaque contrat future via le compte de marge. Ce montant en espèces est comptabilisé sous le poste "Avoirs à vue" du compte de fortune et le montant correspondant est comptabilisé sous le poste "Gains et pertes en capitaux réalisés" du compte de résultat. Pour cette raison, les futures n'ont pas de gains/pertes non réalisés à la clôture et figure donc à zéro dans le compte de fortune et dans l'inventaire.

# Rapport annuel

## Dominicé - European Equities Plus

### Taux de change

au 31.12.2022

CHF	0.9864 = 1 EUR
DKK	7.4383 = 1 EUR
GBP	0.8854 = 1 EUR
NOK	10.5213 = 1 EUR
PLN	4.6821 = 1 EUR
SEK	11.1227 = 1 EUR
USD	1.0692 = 1 EUR



# Rapport annuel

## Dominicé - European Equities Plus

Les transactions conclues au cours de la période de référence n'apparaissant plus dans l'inventaire au 31.12.2022

Dénomination	Monnaie	Achats	Ventes
<b>Valeurs mobilières</b>			
<b>Actions</b>			
Aedifica	EUR	1'703	2'080
Ageas	EUR	1'955	1'955
Cofinimmo	EUR	3'854	3'854
ELIA GROUP	EUR		872
Proximus	EUR	2'776	2'776
Safran	EUR		1'352
Solvay	EUR		2'748
UCB	EUR	1'839	1'839
Atlantia N	EUR		17'075
Airbus Br Rg	EUR		2'344
Koninkl KPN Br Rg	EUR	195'816	195'816
Roy.Philips Br Rg	EUR	11'467	11'467
Ambu-B Br/Rg	DKK		2'101
DSV Br/Rg	DKK	2'476	2'476
Aroundtown Br	EUR		19'561
Beiersdorf Br	EUR		2'222
Commerzbank Br	EUR	6'963	6'963
Continental Br	EUR	1'259	1'259
Fresenius Br	EUR	1'658	1'658
HelloFresh Br	EUR		513
Merck Br	EUR	646	646
Yara Internation Br	NOK	1'778	1'778
alstria I	EUR		1'802
Carl Zeiss Medite I	EUR	388	388
CTS Eventim I	EUR		982
Erste Group Bk I	EUR		2'170
GEA Group I	EUR	12'838	12'838
LANXESS I	EUR	3'357	3'357
Nemetschek I	EUR		862
PUMA I	EUR	634	634
RWE I	EUR	5'562	5'562
SAP I	EUR	4'000	6'233
adidas N	EUR	793	793
BASF N	EUR	7'000	10'351
Brenntag N	EUR		4'233
Deutsche Bank N	EUR		8'622
Deutsche Post N	EUR	8'849	8'849
Deutsche Telekom N	EUR	22'541	22'541
E.ON N	EUR	45'931	45'931
Hannover Rueck N	EUR		1'110
Infineon Technolo N	EUR		5'393
MTU Aero Engin N	EUR	1'127	1'127
Mercedes-BenzGr N	EUR		1'660
Henkel Pfd Br	EUR	491	2'545
Michelin R	EUR		835
Elisa-A Rg	EUR		4'798
Fastighets Bal Rg-B	SEK	19'320	19'320
Hexagon Rg-B	SEK		6'317
Kesko-B Rg	EUR	2'447	2'447
Kone-B Rg	EUR	4'109	4'109
NIBE Industrie Rg-B	SEK		7'227
SSAB-B Rg	SEK	6'909	6'909
Aker BP Rg	NOK	2'032	2'032
Avast Rg	GBP	23'896	23'896
Aviva Rg	GBP		16'688
BHP Grp Rg	GBP	13'809	13'809
BHP Grp Rg	GBP		13'809
Brit Amer Tobacc Rg	GBP		4'121
Daim Tr Hld I 21 Rg	EUR		830
Danske Bank Rg	DKK		22'976
Delivery Hero Rg	EUR		211
Demant Rg	DKK		2'647
DNB Bk Rg	NOK	10'353	10'353
EXOR Rg	EUR	1'662	1'662
Fortum Rg	EUR	10'137	10'137
Genmab Rg	DKK	243	243
Gjensidige Forsi Rg	NOK	4'292	4'292
GSK Rg	GBP		8'947
Hiscox Rg	GBP	29'625	32'475
Indutrade Rg	SEK		1'300
ING Group Rg	EUR	42'737	42'737

# Rapport annuel

## Dominicé - European Equities Plus

Les transactions conclues au cours de la période de référence n'apparaissant plus dans l'inventaire au 31.12.2022

Dénomination	Monnaie	Achats	Ventes
IWG Rg	GBP		16'630
Michelin Rg	EUR	3'340	3'340
Mowi Rg	NOK	8'808	8'808
Neste Rg	EUR	2'600	2'600
Nordic Semicondu Rg	NOK		2'006
Norsk Hydro Rg	NOK	16'964	16'964
NortonLifeLock Rg	USD	722	722
Orkla Rg	NOK	50'314	50'314
Orsted Rg	DKK		1'577
Pandora Rg	DKK	1'534	1'534
Qiagen Rg	EUR	8'153	8'153
SalMar Rg	NOK	1'477	1'477
Storebrand Rg	NOK	15'197	15'197
Telenor Rg	NOK	37'572	37'572
Telia Company Rg	SEK	54'835	54'835
Tomra Sys Rg	NOK	3'308	3'308
Tomra Systems Rg	NOK		1'654
Upm-Kymmene Corp Rg	EUR		1'178
S-E Banken -A-	SEK	24'669	24'669
Balder -B-	SEK		3'220
Carlsberg -B-	DKK		3'487
Hennes&Mauritz -B-	SEK	19'561	19'561
Husqvarna -B-	SEK		12'462
AB InBev	EUR		6'695
Chr. Hansen Holding	DKK		799
Colruyt	EUR	4'859	4'859
Royal UNIBREW	DKK	740	740
Umicore	EUR	1'270	1'270
Swedbank -A-	SEK	42'304	42'304
Porsche A Hldg Vz I	EUR		4'061

### Autres titres de participation et droit

Rights ELIA G Rts 23.06.22 2022-23.06.2022 For Shares	EUR	872	872
---	-----	-----	-----

### Produits dérivés

#### Options d'achat

Option on index ODAX C E 13000 JUL Call 13000 July 2022	EUR	6	6
Option on index ODAX C E 13200 SEP Call 13200 September 2022	EUR	9	9
Option on index ODAX C E 13700 AUG Call 13700 August 2022	EUR	4	4
Option on index ODAX C E 14600 DEC Call 14600 December 2022	EUR	2	2
Option on index ODAX C E 14600 JUN Call 14600 June 2022	EUR	1	1
Option on index ODAX C E 14800 DEC Call 14800 December 2022	EUR	1	1
Option on index ODX1 C E 13400 JUL Call 13400 July 2022	EUR	3	3
Option on index ODX1 C E 14600 DEC Call 14600 December 2022	EUR	1	1
Option on index ODX2 C E 12600 OCT Call 12600 October 2022	EUR	11	11
Option on index ODX4 C E 13900 AUG Call 13900 August 2022	EUR	7	7
Option on index ODX4 C E 14800 DEC Call 14800 December 2022	EUR	3	3
Option on index ODX5 C E 12600 SEP Call 12600 September 2022	EUR	10	10
Option on index ODX5 C E 12750 SEP Call 12750 September 2022	EUR	9	9
Option on index OES1 C E 3500 OCT22 Call 3500 October 2022	EUR	11	11
Option on index OES1 C E 3550 JUL22 Call 3550 July 2022	EUR	4	4
Option on index OES1 C E 3600 SEP22 Call 3600 September 2022	EUR	9	9
Option on index OES2 C E 3400 OCT22 Call 3400 October 2022	EUR	9	9
Option on index OES2 C E 3475 OCT22 Call 3475 October 2022	EUR	16	16
Option on index OES2 C E 3550 JUL22 Call 3550 July 2022	EUR	12	12
Option on index OES2 C E 3600 JUL22 Call 3600 July 2022	EUR	3	3
Option on index OES2 C E 3650 SEP22 Call 3650 September 2022	EUR	7	7
Option on index OES2 C E 3800 JUN22 Call 3800 June 2022	EUR	7	7
Option on index OES4 C E 3500 SEP22 Call 3500 September 2022	EUR	3	3
Option on index OES4 C E 3850 JUN22 Call 3850 June 2022	EUR	1	1
Option on index OES4 C E 4050 DEC22 Call 4050 December 2022	EUR	2	2
Option on index OESX C E 3500 JUL22 Call 3500 July 2022	EUR	6	6
Option on index OESX C E 3550 SEP22 Call 3550 September 2022	EUR	10	10
Option on index OESX C E 3625 SEP22 Call 3625 September 2022	EUR	1	1
Option on index OESX C E 3850 JUN22 Call 3850 June 2022	EUR	6	6
Option on index OMSX C E 3450 SEP22 Call 3450 September 2022	EUR	10	10
Option on index OMSX C E 3575 SEP22 Call 3575 September 2022	EUR	2	2
Option on index OMSX C E 3600 SEP22 Call 3600 September 2022	EUR	1	1
Option on index OMSX C E 3650 JUN22 Call 3650 June 2022	EUR	8	8
Option on index OMSX C E 3700 SEP22 Call 3700 September 2022	EUR	1	1
Option on index OMSX C E 3900 DEC22 Call 3900 December 2022	EUR	1	1
Option on index ODAX C E 12850 JUL Call 12850 July 2022	EUR	7	7
Option on index ODAX C E 13200 JUN Call 13200 June 2025	EUR	9	9

# Rapport annuel

## Dominicé - European Equities Plus

Les transactions conclues au cours de la période de référence n'apparaissant plus dans l'inventaire au 31.12.2022

Dénomination	Monnaie	Achats	Ventes
Option on index ODAX C E 13300 JUL Call 13300 July 2022	EUR	4	4
Option on index ODAX C E 13400 JUN Call 13400 June 2025	EUR	11	11
Option on index ODAX C E 13400 SEP Call 13400 September 2022	EUR	13	13
Option on index ODAX C E 13600 JUN Call 13600 June 2025	EUR	10	10
Option on index ODAX C E 13700 SEP Call 13700 September 2022	EUR	7	7
Option on index ODAX C E 13800 JUN Call 13800 June 2025	EUR	10	10
Option on index ODAX C E 14000 JUN Call 14000 June 2022	EUR	10	10
Option on index ODAX C E 14200 DEC Call 14200 December 2022	EUR	8	8
Option on index ODAX C E 14200 JUN Call 14200 June 2022	EUR	10	10
Option on index ODAX C E 14400 DEC Call 14400 December 2022	EUR	8	8
Option on index ODAX C E 14400 JUN Call 14400 June 2022	EUR	10	10
Option on index ODX1 C E 12500 OCT Call 12500 October 2022	EUR	13	13
Option on index ODX1 C E 12800 JUL Call 12800 July 2022	EUR	10	10
Option on index ODX1 C E 13000 JUL Call 13000 July 2022	EUR	11	11
Option on index ODX1 C E 13000 SEP Call 13000 September 2022	EUR	8	8
Option on index ODX1 C E 13100 OCT Call 13100 October 2022	EUR	1	1
Option on index ODX1 C E 13150 SEP Call 13150 September 2022	EUR	8	8
Option on index ODX1 C E 13200 JUL Call 13200 July 2022	EUR	11	11
Option on index ODX1 C E 13300 SEP Call 13300 September 2022	EUR	8	8
Option on index ODX1 C E 13450 SEP Call 13450 September 2022	EUR	7	7
Option on index ODX2 C E 13250 SEP Call 13250 September 2022	EUR	9	9
Option on index ODX2 C E 13500 SEP Call 13500 September 2022	EUR	6	6
Option on index ODX2 C E 14300 JUN Call 14300 June 2022	EUR	9	9
Option on index ODX4 C E 12500 SEP Call 12500 September 2022	EUR	11	11
Option on index ODX4 C E 12650 SEP Call 12650 September 2022	EUR	11	11
Option on index ODX4 C E 12800 SEP Call 12800 September 2022	EUR	11	11
Option on index ODX4 C E 13150 JUN Call 13150 June 2022	EUR	11	11
Option on index ODX4 C E 13150 SEP Call 13150 September 2022	EUR	11	11
Option on index ODX4 C E 13300 JUN Call 13300 June 2022	EUR	10	10
Option on index ODX4 C E 13500 JUN Call 13500 June 2022	EUR	10	10
Option on index ODX4 C E 13700 AUG Call 13700 August 2022	EUR	8	8
Option on index ODX4 C E 13700 JUN Call 13700 June 2022	EUR	6	6
Option on index ODX4 C E 13900 JUN Call 13900 June 2022	EUR	2	2
Option on index ODX4 C E 14100 DEC Call 14100 December 2022	EUR	7	7
Option on index ODX4 C E 14100 JUN Call 14100 June 2022	EUR	8	8
Option on index ODX4 C E 14300 JUN Call 14300 June 2022	EUR	8	8
Option on index ODX4 C E 14500 DEC Call 14500 December 2022	EUR	7	7
Option on index ODX5 C E 12150 SEP Call 12150 September 2022	EUR	10	10
Option on index ODX5 C E 12300 SEP Call 12300 September 2022	EUR	11	11
Option on index ODX5 C E 12450 SEP Call 12450 September 2022	EUR	13	13
Option on index ODX5 C E 13050 SEP Call 13050 September 2022	EUR	10	10
Option on index OES1 C E 3450 OCT22 Call 3450 October 2022	EUR	10	10
Option on index OES1 C E 3500 SEP22 Call 3500 September 2022	EUR	7	7
Option on index OES1 C E 3550 SEP22 Call 3550 September 2022	EUR	11	11
Option on index OES1 C E 3575 SEP22 Call 3575 September 2022	EUR	7	7
Option on index OES1 C E 3650 SEP22 Call 3650 September 2022	EUR	9	9
Option on index OES1 C E 3700 SEP22 Call 3700 September 2022	EUR	9	9
Option on index OES1 C E 3825 JUN22 Call 3825 June 2022	EUR	6	6
Option on index OES1 C E 4050 DEC22 Call 4050 December 2022	EUR	22	22
Option on index OES2 C E 3425 OCT22 Call 3425 October 2022	EUR	7	7
Option on index OES2 C E 3700 MAY22 Call 3700 May 2022	EUR	5	5
Option on index OES2 C E 3700 SEP22 Call 3700 September 2022	EUR	7	7
Option on index OES2 C E 3725 JUN22 Call 3725 June 2022	EUR	6	6
Option on index OES4 C E 3400 SEP22 Call 3400 September 2022	EUR	6	6
Option on index OES4 C E 3425 SEP22 Call 3425 September 2022	EUR	13	13
Option on index OES4 C E 3450 SEP22 Call 3450 September 2022	EUR	16	16
Option on index OES4 C E 3475 SEP22 Call 3475 September 2022	EUR	9	9
Option on index OES4 C E 3500 JUN22 Call 3500 June 2022	EUR	14	14
Option on index OES4 C E 3550 JUN22 Call 3550 June 2022	EUR	14	14
Option on index OES4 C E 3550 SEP22 Call 3550 September 2022	EUR	16	16
Option on index OES4 C E 3600 JUN22 Call 3600 June 2022	EUR	22	22
Option on index OES4 C E 3650 JUN22 Call 3650 June 2022	EUR	20	20
Option on index OES4 C E 3700 AUG22 Call 3700 August 2022	EUR	11	11
Option on index OES4 C E 3700 OCT22 Call 3700 October 2022	EUR	22	22
Option on index OES4 C E 3750 AUG22 Call 3750 August 2022	EUR	8	8
Option on index OES4 C E 3750 JUN22 Call 3750 June 2022	EUR	22	22
Option on index OES4 C E 3800 AUG22 Call 3800 August 2022	EUR	8	8
Option on index OES4 C E 3800 JUN22 Call 3800 June 2022	EUR	6	6
Option on index OES4 C E 3850 DEC22 Call 3850 December 2022	EUR	10	10
Option on index OES4 C E 3900 DEC22 Call 3900 December 2022	EUR	11	11
Option on index OES4 C E 3950 DEC22 Call 3950 December 2022	EUR	11	11
Option on index OES4 C E 4000 DEC22 Call 4000 December 2022	EUR	6	6
Option on index OESX C E 3450 JUL22 Call 3450 July 2022	EUR	15	15
Option on index OESX C E 3500 JUN22 Call 3500 June 2022	EUR	11	11
Option on index OESX C E 3525 JUN22 Call 3525 June 2022	EUR	7	7
Option on index OESX C E 3525 SEP22 Call 3525 September 2022	EUR	14	14

# Rapport annuel

## Dominicé - European Equities Plus

Les transactions conclues au cours de la période de référence n'apparaissant plus dans l'inventaire au 31.12.2022

Dénomination	Monnaie	Achats	Ventes
Option on index OESX C E 3550 JUL22 Call 3550 July 2022	EUR	11	11
Option on index OESX C E 3550 JUN22 Call 3550 June 2022	EUR	15	15
Option on index OESX C E 3575 JUN22 Call 3575 June 2022	EUR	7	7
Option on index OESX C E 3575 SEP22 Call 3575 September 2022	EUR	14	14
Option on index OESX C E 3600 JUL22 Call 3600 July 2022	EUR	6	6
Option on index OESX C E 3600 JUN22 Call 3600 June 2022	EUR	8	8
Option on index OESX C E 3600 OCT22 Call 3600 October 2022	EUR	7	7
Option on index OESX C E 3600 SEP22 Call 3600 September 2022	EUR	18	18
Option on index OESX C E 3625 JUN22 Call 3625 June 2022	EUR	13	13
Option on index OESX C E 3650 JUN22 Call 3650 June 2022	EUR	11	11
Option on index OESX C E 3700 JUN22 Call 3700 June 2022	EUR	15	15
Option on index OESX C E 3700 MAY22 Call 3700 May 2022	EUR	10	10
Option on index OESX C E 3800 JUN22 Call 3800 June 2022	EUR	15	15
Option on index OESX C E 3800 SEP22 Call 3800 September 2022	EUR	10	10
Option on index OESX C E 3825 DEC22 Call 3825 December 2022	EUR	3	3
Option on index OESX C E 3900 DEC22 Call 3900 December 2022	EUR	10	10
Option on index OESX C E 3950 DEC22 Call 3950 December 2022	EUR	20	20
Option on index OESX C E 3975 DEC22 Call 3975 December 2022	EUR	11	11
Option on index OMSX C E 3325 SEP22 Call 3325 September 2022	EUR	19	19
Option on index OMSX C E 3350 SEP22 Call 3350 September 2022	EUR	19	19
Option on index OMSX C E 3400 SEP22 Call 3400 September 2022	EUR	11	11
Option on index OMSX C E 3425 SEP22 Call 3425 September 2022	EUR	16	16
Option on index OMSX C E 3475 JUN22 Call 3475 June 2022	EUR	8	8
Option on index OMSX C E 3500 JUN22 Call 3500 June 2022	EUR	10	10
Option on index OMSX C E 3500 SEP22 Call 3500 September 2022	EUR	17	17
Option on index OMSX C E 3550 JUN22 Call 3550 June 2022	EUR	10	10
Option on index OMSX C E 3550 SEP22 Call 3550 September 2022	EUR	15	15
Option on index OMSX C E 3600 AUG22 Call 3600 August 2022	EUR	8	8
Option on index OMSX C E 3600 JUN22 Call 3600 June 2022	EUR	8	8
Option on index OMSX C E 3650 AUG22 Call 3650 August 2022	EUR	8	8
Option on index OMSX C E 3850 DEC22 Call 3850 December 2022	EUR	9	9
Option on index OMSX C E 3900 MAY22 Call 3900 May 2022	EUR	33	33
Option on index OMSX C E 4000 NOV22 Call 4000 November 2022	EUR	13	13
Option on index ODX1 C E 13700 AUG Call 13700 August 2022	EUR	1	1
Option on index OES2 C E 3450 OCT22 Call 3450 October 2022	EUR	18	18
Option on index OES2 C E 3900 NOV22 Call 3900 November 2022	EUR	9	9
<b>Options vendues</b>			
Option on index ODAX P E 12300 JUL Put 12300 July 2022	EUR	1	1
Option on index ODAX P E 12300 OCT Put 12300 October 2022	EUR	7	7
Option on index ODAX P E 12500 OCT Put 12500 October 2022	EUR	1	1
Option on index ODAX P E 12600 SEP Put 12600 September 2022	EUR	1	1
Option on index ODAX P E 12800 NOV Put 12800 November 2022	EUR	9	9
Option on index ODAX P E 13100 AUG Put 13100 August 2022	EUR	1	1
Option on index ODAX P E 13400 AUG Put 13400 August 2022	EUR	1	1
Option on index ODX1 P E 12100 OCT Put 12100 October 2022	EUR	1	1
Option on index ODX1 P E 12300 NOV Put 12300 November 2022	EUR	1	1
Option on index ODX1 P E 12300 OCT Put 12300 October 2022	EUR	1	1
Option on index ODX1 P E 12500 NOV Put 12500 November 2022	EUR	9	9
Option on index ODX1 P E 12700 AUG Put 12700 August 2022	EUR	1	1
Option on index ODX1 P E 12700 NOV Put 12700 November 2022	EUR	11	11
Option on index ODX1 P E 12800 SEP Put 12800 September 2022	EUR	4	4
Option on index ODX1 P E 12900 AUG Put 12900 August 2022	EUR	5	5
Option on index ODX1 P E 13100 AUG Put 13100 August 2022	EUR	1	1
Option on index ODX1 P E 13300 AUG Put 13300 August 2022	EUR	5	5
Option on index ODX1 P E 14200 DEC Put 14200 December 2022	EUR	1	1
Option on index ODX1 P E 14400 DEC Put 14400 December 2022	EUR	1	1
Option on index ODX2 P E 11800 OCT Put 11800 October 2022	EUR	1	1
Option on index ODX2 P E 12000 OCT Put 12000 October 2022	EUR	1	1
Option on index ODX2 P E 12400 OCT Put 12400 October 2022	EUR	5	5
Option on index ODX2 P E 12700 JUL Put 12700 July 2022	EUR	1	1
Option on index ODX2 P E 12750 SEP Put 12750 September 2022	EUR	1	1
Option on index ODX2 P E 13000 SEP Put 13000 September 2022	EUR	3	3
Option on index ODX2 P E 13300 AUG Put 13300 August 2022	EUR	5	5
Option on index ODX2 P E 13500 AUG Put 13500 August 2022	EUR	5	5
Option on index ODX4 P E 12000 JUL Put 12000 July 2022	EUR	1	1
Option on index ODX4 P E 12300 JUL Put 12300 July 2022	EUR	1	1
Option on index ODX4 P E 12450 JUL Put 12450 July 2022	EUR	1	1
Option on index ODX4 P E 12600 JUL Put 12600 July 2022	EUR	1	1
Option on index ODX4 P E 13100 AUG Put 13100 August 2022	EUR	6	6
Option on index ODX5 P E 12300 JUL Put 12300 July 2022	EUR	1	1
Option on index ODX5 P E 13100 JUL Put 13100 July 2022	EUR	1	1
Option on index OES1 P E 3150 OCT22 Put 3150 October 2022	EUR	17	17
Option on index OES1 P E 3200 OCT22 Put 3200 October 2022	EUR	43	43
Option on index OES1 P E 3250 OCT22 Put 3250 October 2022	EUR	11	11
Option on index OES1 P E 3300 JUL22 Put 3300 July 2022	EUR	11	11

# Rapport annuel

## Dominicé - European Equities Plus

Les transactions conclues au cours de la période de référence n'apparaissant plus dans l'inventaire au 31.12.2022

Dénomination	Monnaie	Achats	Ventes
Option on index OES1 P E 3350 AUG22 Put 3350 August 2022	EUR	11	11
Option on index OES1 P E 3350 OCT22 Put 3350 October 2022	EUR	11	11
Option on index OES1 P E 3425 OCT22 Put 3425 October 2022	EUR	9	9
Option on index OES1 P E 3500 AUG22 Put 3500 August 2022	EUR	10	10
Option on index OES1 P E 3500 JUN22 Put 3500 June 2022	EUR	10	10
Option on index OES1 P E 3550 AUG22 Put 3550 August 2022	EUR	19	19
Option on index OES1 P E 3550 NOV22 Put 3550 November 2022	EUR	11	11
Option on index OES1 P E 3600 JUN22 Put 3600 June 2022	EUR	9	9
Option on index OES1 P E 3650 JUN22 Put 3650 June 2022	EUR	11	11
Option on index OES1 P E 3700 JUN22 Put 3700 June 2022	EUR	10	10
Option on index OES1 P E 3800 DEC22 Put 3800 December 2022	EUR	19	19
Option on index OES2 P E 3150 OCT22 Put 3150 October 2022	EUR	10	10
Option on index OES2 P E 3175 OCT22 Put 3175 October 2022	EUR	10	10
Option on index OES2 P E 3325 OCT22 Put 3325 October 2022	EUR	1	1
Option on index OES2 P E 3350 OCT22 Put 3350 October 2022	EUR	4	4
Option on index OES2 P E 3425 SEP22 Put 3425 September 2022	EUR	1	1
Option on index OES2 P E 3450 JUN22 Put 3450 June 2022	EUR	6	6
Option on index OES2 P E 3450 SEP22 Put 3450 September 2022	EUR	1	1
Option on index OES2 P E 3475 SEP22 Put 3475 September 2022	EUR	1	1
Option on index OES2 P E 3500 AUG22 Put 3500 August 2022	EUR	11	11
Option on index OES2 P E 3500 SEP22 Put 3500 September 2022	EUR	1	1
Option on index OES2 P E 3550 JUN22 Put 3550 June 2022	EUR	11	11
Option on index OES2 P E 3600 JUN22 Put 3600 June 2022	EUR	23	23
Option on index OES2 P E 3625 NOV22 Put 3625 November 2022	EUR	5	5
Option on index OES2 P E 3700 AUG22 Put 3700 August 2022	EUR	7	7
Option on index OES2 P E 3725 AUG22 Put 3725 August 2022	EUR	1	1
Option on index OES4 P E 3200 OCT22 Put 3200 October 2022	EUR	21	21
Option on index OES4 P E 3300 JUL22 Put 3300 July 2022	EUR	11	11
Option on index OES4 P E 3300 JUN22 Put 3300 June 2022	EUR	22	22
Option on index OES4 P E 3300 OCT22 Put 3300 October 2022	EUR	21	21
Option on index OES4 P E 3350 JUL22 Put 3350 July 2022	EUR	6	6
Option on index OES4 P E 3400 JUN22 Put 3400 June 2022	EUR	1	1
Option on index OES4 P E 3400 MAY22 Put 3400 May 2022	EUR	6	6
Option on index OES4 P E 3400 OCT22 Put 3400 October 2022	EUR	22	22
Option on index OES4 P E 3450 JUL22 Put 3450 July 2022	EUR	6	6
Option on index OES4 P E 3550 MAY22 Put 3550 May 2022	EUR	11	11
Option on index OES4 P E 3550 OCT22 Put 3550 October 2022	EUR	6	6
Option on index OES4 P E 3600 AUG22 Put 3600 August 2022	EUR	11	11
Option on index OES4 P E 3600 MAY22 Put 3600 May 2022	EUR	12	12
Option on index OES4 P E 3625 AUG22 Put 3625 August 2022	EUR	12	12
Option on index OES4 P E 3650 MAY22 Put 3650 May 2022	EUR	13	13
Option on index OES4 P E 3650 NOV22 Put 3650 November 2022	EUR	6	6
Option on index OES4 P E 3700 MAY22 Put 3700 May 2022	EUR	1	1
Option on index OES4 P E 3700 NOV22 Put 3700 November 2022	EUR	6	6
Option on index OES4 P E 3800 DEC22 Put 3800 December 2022	EUR	1	1
Option on index OES4 P E 3850 NOV22 Put 3850 November 2022	EUR	7	7
Option on index OESX P E 3150 OCT22 Put 3150 October 2022	EUR	1	1
Option on index OESX P E 3250 OCT22 Put 3250 October 2022	EUR	1	1
Option on index OESX P E 3300 OCT22 Put 3300 October 2022	EUR	6	6
Option on index OESX P E 3300 SEP22 Put 3300 September 2022	EUR	11	11
Option on index OESX P E 3350 JUL22 Put 3350 July 2022	EUR	2	2
Option on index OESX P E 3350 OCT22 Put 3350 October 2022	EUR	1	1
Option on index OESX P E 3400 JUL22 Put 3400 July 2022	EUR	1	1
Option on index OESX P E 3400 JUN22 Put 3400 June 2022	EUR	1	1
Option on index OESX P E 3425 OCT22 Put 3425 October 2022	EUR	3	3
Option on index OESX P E 3450 SEP22 Put 3450 September 2022	EUR	11	11
Option on index OESX P E 3500 NOV22 Put 3500 November 2022	EUR	5	5
Option on index OESX P E 3550 AUG22 Put 3550 August 2022	EUR	1	1
Option on index OESX P E 3650 AUG22 Put 3650 August 2022	EUR	1	1
Option on index OESX P E 3750 AUG22 Put 3750 August 2022	EUR	7	7
Option on index OESX P E 3800 NOV22 Put 3800 November 2022	EUR	5	5
Option on index OESX P E 3825 NOV22 Put 3825 November 2022	EUR	5	5
Option on index OMSX P E 3275 SEP22 Put 3275 September 2022	EUR	1	1
Option on index OMSX P E 3300 SEP22 Put 3300 September 2022	EUR	12	12
Option on index OMSX P E 3350 JUN22 Put 3350 June 2022	EUR	1	1
Option on index OMSX P E 3400 JUL22 Put 3400 July 2022	EUR	9	9
Option on index OMSX P E 3450 JUL22 Put 3450 July 2022	EUR	3	3
Option on index OMSX P E 3500 JUL22 Put 3500 July 2022	EUR	19	19
Option on index OMSX P E 3500 MAY22 Put 3500 May 2022	EUR	11	11
Option on index OMSX P E 3550 JUL22 Put 3550 July 2022	EUR	10	10
Option on index OMSX P E 3550 MAY22 Put 3550 May 2022	EUR	15	15
Option on index OMSX P E 3550 OCT22 Put 3550 October 2022	EUR	5	5
Option on index OMSX P E 3600 MAY22 Put 3600 May 2022	EUR	3	3
Option on index OMSX P E 3650 MAY22 Put 3650 May 2022	EUR	21	21
Option on index OMSX P E 3700 MAY22 Put 3700 May 2022	EUR	12	12
Option on index OMSX P E 3800 DEC22 Put 3800 December 2022	EUR	1	1

# Rapport annuel

## Dominicé - European Equities Plus

Les transactions conclues au cours de la période de référence n'apparaissant plus dans l'inventaire au 31.12.2022

Dénomination	Monnaie	Achats	Ventes
Option on index ODAX P E 13200 NOV Put 13200 November 2022	EUR	12	12
Option on index ODAX P E 13400 NOV Put 13400 November 2022	EUR	13	13
Option on index ODX1 P E 12900 NOV Put 12900 November 2022	EUR	9	9
Option on index ODX1 P E 13500 AUG Put 13500 August 2022	EUR	10	10
Option on index ODX1 P E 14300 JUN Put 14300 June 2022	EUR	8	8
Option on index ODX2 P E 13400 NOV Put 13400 November 2022	EUR	8	8
Option on index ODX4 P E 12500 OCT Put 12500 October 2022	EUR	11	11
Option on index ODX4 P E 12600 OCT Put 12600 October 2022	EUR	12	12
Option on index ODX4 P E 12800 OCT Put 12800 October 2022	EUR	14	14
Option on index ODX4 P E 12900 JUL Put 12900 July 2022	EUR	10	10
Option on index ODX4 P E 13500 NOV Put 13500 November 2022	EUR	10	10
Option on index ODX4 P E 13700 NOV Put 13700 November 2022	EUR	14	14
Option on index ODX4 P E 14300 NOV Put 14300 November 2022	EUR	7	7
Option on index ODX4 P E 14500 NOV Put 14500 November 2022	EUR	7	7
Option on index ODX5 P E 12700 JUL Put 12700 July 2022	EUR	10	10
Option on index ODX5 P E 13300 JUL Put 13300 July 2022	EUR	10	10
Option on index OES1 P E 3100 OCT22 Put 3100 October 2022	EUR	20	20
Option on index OES1 P E 3500 NOV22 Put 3500 November 2022	EUR	10	10
Option on index OES1 P E 3600 AUG22 Put 3600 August 2022	EUR	11	11
Option on index OES1 P E 3600 NOV22 Put 3600 November 2022	EUR	13	13
Option on index OES1 P E 3700 AUG22 Put 3700 August 2022	EUR	12	12
Option on index OES1 P E 3750 JUN22 Put 3750 June 2022	EUR	7	7
Option on index OES1 P E 3800 JUN22 Put 3800 June 2022	EUR	7	7
Option on index OES1 P E 3950 DEC22 Put 3950 December 2022	EUR	10	10
Option on index OES1 P E 3975 DEC22 Put 3975 December 2022	EUR	4	4
Option on index OES2 P E 3000 OCT22 Put 3000 October 2022	EUR	22	22
Option on index OES2 P E 3175 JUL22 Put 3175 July 2022	EUR	22	22
Option on index OES2 P E 3400 MAY22 Put 3400 May 2022	EUR	5	5
Option on index OES2 P E 3600 NOV22 Put 3600 November 2022	EUR	10	10
Option on index OES2 P E 3650 NOV22 Put 3650 November 2022	EUR	13	13
Option on index OES2 P E 3700 NOV22 Put 3700 November 2022	EUR	13	13
Option on index OES2 P E 3750 AUG22 Put 3750 August 2022	EUR	10	10
Option on index OES2 P E 3750 NOV22 Put 3750 November 2022	EUR	13	13
Option on index OES4 P E 3450 OCT22 Put 3450 October 2022	EUR	11	11
Option on index OES4 P E 3500 JUL22 Put 3500 July 2022	EUR	16	16
Option on index OES4 P E 3500 OCT22 Put 3500 October 2022	EUR	7	7
Option on index OES4 P E 3550 JUL22 Put 3550 July 2022	EUR	16	16
Option on index OES4 P E 3675 NOV22 Put 3675 November 2022	EUR	4	4
Option on index OES4 P E 3750 NOV22 Put 3750 November 2022	EUR	13	13
Option on index OES4 P E 3825 NOV22 Put 3825 November 2022	EUR	44	44
Option on index OES4 P E 3900 NOV22 Put 3900 November 2022	EUR	10	10
Option on index OES4 P E 3950 NOV22 Put 3950 November 2022	EUR	3	3
Option on index OESX P E 3400 OCT22 Put 3400 October 2022	EUR	13	13
Option on index OESX P E 3500 AUG22 Put 3500 August 2022	EUR	11	11
Option on index OESX P E 3700 AUG22 Put 3700 August 2022	EUR	13	13
Option on index OESX P E 3750 NOV22 Put 3750 November 2022	EUR	10	10
Option on index OMSX P E 3000 SEP22 Put 3000 September 2022	EUR	33	33
Option on index OMSX P E 3100 SEP22 Put 3100 September 2022	EUR	11	11
Option on index OMSX P E 3575 OCT22 Put 3575 October 2022	EUR	11	11
Option on index OMSX P E 3600 JUL22 Put 3600 July 2022	EUR	16	16
Option on index OMSX P E 3650 JUL22 Put 3650 July 2022	EUR	16	16
Option on index OMSX P E 3775 MAY22 Put 3775 May 2022	EUR	4	4
Option on index OMSX P E 3800 MAY22 Put 3800 May 2022	EUR	4	4
Option on index OMSX P E 3825 NOV22 Put 3825 November 2022	EUR	14	14
Option on index OMSX P E 3950 NOV22 Put 3950 November 2022	EUR	12	12
Option on index OES2 P E 3650 JUN22 Put 3650 June 2022	EUR	4	4
Option on index ODAX P E 12700 JUL Put 12700 July 2022	EUR	3	3
Option on index ODAX P E 13150 JUN Put 13150 June 2022	EUR	3	3
Option on index ODX1 P E 13200 NOV Put 13200 November 2022	EUR	9	9
Option on index ODX2 P E 12900 JUL Put 12900 July 2022	EUR	6	6
Option on index ODX2 P E 13700 AUG Put 13700 August 2022	EUR	3	3
Option on index ODX4 P E 13000 JUN Put 13000 June 2022	EUR	12	12
Option on index ODX4 P E 13100 OCT Put 13100 October 2022	EUR	3	3
Option on index ODX5 P E 12000 SEP Put 12000 September 2022	EUR	10	10
Option on index OES2 P E 3550 SEP22 Put 3550 September 2022	EUR	12	12
Option on index OES2 P E 3650 MAY22 Put 3650 May 2022	EUR	5	5
Option on index OES2 P E 3925 DEC22 Put 3925 December 2022	EUR	10	10
Option on index OES4 P E 3475 JUN22 Put 3475 June 2022	EUR	11	11
Option on index OESX P E 3475 JUN22 Put 3475 June 2022	EUR	11	11
<b>Futures</b>			
Future on index FDAX DEC22 December 2022	EUR	151	151
Future on index FESX JUN22 June 2022	EUR	1'455	1'455
Future on index FESX SEP22 September 2022	EUR	1'746	1'746
Future on index FVS APR22 April 2022	EUR	1'712	1'712
Future on index FVS AUG22 August 2022	EUR	1'030	1'030

# Rapport annuel

## Dominicé - European Equities Plus

### Les transactions conclues au cours de la période de référence n'apparaissant plus dans l'inventaire au 31.12.2022

Dénomination	Monnaie	Achats	Ventes
Future on index FVS DEC22 December 2022	EUR	948	948
Future on index FVS FEB22 February 2022	EUR	1'140	956
Future on index FVS JUL22 July 2022	EUR	1'185	1'185
Future on index FVS JUN22 June 2022	EUR	1'581	1'581
Future on index FVS MAY22 May 2022	EUR	1'833	1'833
Future on index FVS NOV22 November 2022	EUR	866	866
Future on index FVS OCT22 October 2022	EUR	1'298	1'298
Future on index FSMI MAR22 March 2022	CHF	7	
Future on index FVS JAN22 January 2022	EUR	561	
Future on index FESX DEC22 December 2022	EUR	2'154	2'154
Future on index FESX MAR22 March 2022	EUR	491	393
Future on index FMEU DEC22 December 2022	EUR	155	155
Future on index FMEU JUN22 June 2022	EUR	198	198
Future on index FMEU SEP22 September 2022	EUR	115	115
Future on index FMEU MAR22 March 2022	EUR		186
<b>Produits de change à terme</b>			
FX Forward EUR CHF 28.02.22			540'720
FX Forward EUR CHF 30.06.22		540'720	540'720
FX Forward EUR CHF 28.10.22		540'720	540'720

#### Notes à propos des listes d'achats / ventes

Les achats englobent entre autres les transactions suivantes :

achats / titres gratuits / conversions / changements de raisons sociales / splits / dividendes en actions / en espèces / répartitions des titres / transferts / échanges entre sociétés / distributions / droits de souscription et d'options / ouvertures sur swaps.

Les ventes englobent entre autres les transactions suivantes :

ventes / tirages au sort / sorties après échéance / exercices de droits de souscription et d'options / conversions / reverse-splits / remboursements / transferts / échanges entre sociétés / clôtures sur swaps / échéances sur swaps.

# Rapport annuel

## Dominicé - European Equities Plus

### Produits dérivés sur application de l'approche Commitment II

#### Instrument financiers dérivés

Description de l'instrument	Monnaie	Taux de change	Positions long	Positions short	Quantité	Prix du sous-jacent	Delta	Taille du contrat	Exposition brute en EUR	Exposition brute en % de la VNI
<b>Futures</b>										
SMH3 INDEX	CHF	0.99		-6	-6	10729.4		10	635'007.39	2.49%
GXH3 INDEX	EUR	1.00	13	-16	-3	13923.59		25	10'094'602.75	39.63%
VGH3 INDEX	EUR	1.00	51	-143	-92	3793.62		10	7'359'622.80	28.90%
VGH3 INDEX	EUR	1.00	100	-132	-32	3793.62		10	8'801'198.40	34.55%
VGH3 INDEX	EUR	1.00	39		39	3793.62		10	1'479'511.80	5.81%
ZRPH3 INDEX	EUR	1.00	155		155	267.15		100	4'140'825.00	16.26%
FVSG3 INDEX	EUR	1.00		-155	-155	20.8862		100	323'736.10	1.27%
FVSF3 INDEX	EUR	1.00	447	-841	-394	20.8862		100	2'690'142.56	10.56%
<b>Options</b>										
DAX 01/20/23 C14200 INDEX	EUR	1.00		-3	-3	13923.59	0.329	5	68'712.92	0.27%
DAX 01/20/23 P13400 INDEX	EUR	1.00		-7	-7	13923.59	-0.207	5	100'876.41	0.40%
DAX 01/20/23 P13600 INDEX	EUR	1.00		-7	-7	13923.59	-0.293	5	142'786.42	0.56%
DAX 01/20/23 P13800 INDEX	EUR	1.00		-6	-6	13923.59	-0.403	5	168'336.20	0.66%
DAX 01/20/23 P14000 INDEX	EUR	1.00		-6	-6	13923.59	-0.533	5	222'638.20	0.87%
WDAXA 01/06/23 C14100 INDEX	EUR	1.00		-6	-6	13923.59	0.291	5	121'552.94	0.48%
WDAXA 01/06/23 P13700 INDEX	EUR	1.00		-6	-6	13923.59	-0.25	5	104'426.93	0.41%
WDAXA 01/06/23 P13900 INDEX	EUR	1.00		-6	-6	13923.59	-0.461	5	192'563.25	0.76%
WDAXB 01/13/23 C14200 INDEX	EUR	1.00		-3	-3	13923.59	0.291	5	60'776.47	0.24%
WDAXB 01/13/23 P13600 INDEX	EUR	1.00		-3	-3	13923.59	-0.266	5	55'555.12	0.22%
WDAXB 01/13/23 P13900 INDEX	EUR	1.00		-3	-3	13923.59	-0.468	5	97'743.60	0.38%
WSX5EA 01/06/23 C3800 INDEX	EUR	1.00		-2	-2	3793.62	0.454	10	34'446.07	0.14%
WSX5EA 01/06/23 C3850 INDEX	EUR	1.00		-9	-9	3793.62	0.221	10	75'455.10	0.30%
WSX5EA 01/06/23 C3900 INDEX	EUR	1.00		-7	-7	3793.62	0.09	10	23'899.81	0.09%
WSX5EA 01/06/23 P3700 INDEX	EUR	1.00		-7	-7	3793.62	-0.167	10	44'347.42	0.17%
WSX5EA 01/06/23 P3750 INDEX	EUR	1.00		-9	-9	3793.62	-0.33	10	112'670.51	0.44%
WSX5EA 01/06/23 P3800 INDEX	EUR	1.00		-9	-9	3793.62	-0.529	10	180'614.25	0.71%
WSX5EB 01/13/23 C3900 INDEX	EUR	1.00		-7	-7	3793.62	0.193	10	51'251.81	0.20%
WSX5EB 01/13/23 P3700 INDEX	EUR	1.00		-7	-7	3793.62	-0.273	10	72'496.08	0.28%
WSX5EB 01/13/23 P3800 INDEX	EUR	1.00		-7	-7	3793.62	-0.521	10	138'353.32	0.54%
SX5E 02/17/23 P3650 INDEX	EUR	1.00		-11	-11	3793.62	-0.308	10	128'527.85	0.50%
SX5E 01/20/23 P3700 INDEX	EUR	1.00		-22	-22	3793.62	-0.309	10	257'890.29	1.01%
SX5E 02/17/23 P3750 INDEX	EUR	1.00		-22	-22	3793.62	-0.435	10	363'049.43	1.43%
<b>Produits de change à terme</b>										
FX Forward EUR CHF 24.02.23	CHF	0.99							540'637.34	2.12%
<b>Engagement total brut issu de dérivés</b>									<b>38'884'254.53</b>	<b>152.67%</b>
<b>Compensation</b>									<b>28'818'655.80</b>	<b>113.15%</b>
<b>Engagement total net issu de dérivés</b>									<b>10'065'598.73</b>	<b>39.52%</b>
<b>VNI</b>									<b>25'470'194.90</b>	

### Rémunérations et frais à la charge de l'investisseur :

(extrait du § 18 du contrat de fonds)

#### Classes «A»

Commission d'émission en faveur de la direction du fonds, de la banque dépositaire, et/ou des distributeurs en Suisse et à l'étranger

Taux maximum (pa)	Taux effectif (pa)
1.00%	0%
de la valeur nette d'inventaire des parts	de la valeur nette d'inventaire des parts

Commission de rachat en faveur du compartiment et/ou des distributeurs en Suisse et à l'étranger

Taux maximum (pa)	Taux effectif (pa)
0.5%	0%
de la valeur nette d'inventaire	de la valeur nette d'inventaire

#### Rémunérations et frais à la charge de la fortune du compartiment :

(extrait du § 19 du contrat de fonds)

#### Classe «A»

Commission de gestion de la direction du fonds (calculée sur la valeur nette d'inventaire de la classe) utilisée pour la direction, l'Asset Management et la commercialisation de la classe

Taux maximum (pa)	Taux effectif (pa)
1.00%	1.00%

#### Classes «A»

Commission de la banque dépositaire (calculée sur la valeur nette d'inventaire du fonds)

Taux maximum (pa)	Taux effectif (pa)
18'000 CHF + 0.05% (minimum 25'000 CHF)	18'000 CHF + 0.05%

Commission de la banque dépositaire pour le versement du produit annuel aux investisseurs (calculée sur la valeur nette d'inventaire du compartiment)

Taux maximum (pa)	Taux effectif (pa)
0.50%	N/A

En supplément, les autres rémunérations et frais accessoires énumérés dans le § 19 du contrat de fonds peuvent être facturés au compartiment.

Accords de rétrocessions de commissions (« commission sharing agreements ») et commissions en nature (« soft commissions »)



# Rapport annuel

## Dominicé - European Equities Plus

### Instrument financiers dérivés

La direction du fonds n'a pas conclu d'accords de rétrocessions de commissions (« commission sharing agreements »).

La direction du fonds n'a pas conclu des accords concernant des « soft commissions ».

### Principes d'évaluation

Les placements négociés en bourse ou sur un autre marché réglementé ouvert au public doivent être évalués selon les cours du marché principal. D'autres placements ou les placements pour lesquels aucun cours du jour n'est disponible doivent être évalués au prix qui pourrait en être obtenu s'ils étaient vendus avec soin au moment de l'évaluation. Pour la détermination de la valeur vénale, la direction du fonds utilise dans ce cas des modèles et principes d'évaluation appropriés et reconnus dans la pratique.

Les avoirs en banque sont évalués à la valeur nominale et les intérêts courus sont, cas échéant, pris en compte. En cas de changements notables des conditions du marché ou de la solvabilité, la base d'évaluation des avoirs en banque à terme est adaptée aux nouvelles circonstances.

La valeur des instruments du marché monétaire qui ne sont pas négociés à une bourse ou sur un marché réglementé ouvert au public est déterminée de la manière suivante : le prix d'évaluation de tels placements est adapté successivement au prix de rachat, en partant du prix net d'acquisition, avec maintien constant du rendement de placement jusqu'à l'échéance. En cas de changements notables des conditions du marché, la base d'évaluation des différents placements est adaptée aux nouveaux rendements du marché. En cas de prix actuel manquant du marché, on se réfère normalement à l'évaluation d'instruments du marché monétaire présentant des caractéristiques identiques (qualité et siège de l'émetteur, monnaie d'émission, durée).

La valeur des contrats à terme (contrats futures et forwards) et des contrats d'options négociés sur une bourse de valeurs ou un autre marché réglementé doit être déterminée sur la base du prix de clôture ou de règlement publié par la bourse de valeurs ou l'autre marché réglementé qui constitue en règle générale le principal lieu de négociation de ces contrats. Les contrats à terme et d'options qui ne sont pas négociés sur une bourse de valeurs ou un autre marché réglementé (dérivé conclu OTC) sont évalués au moyen de modèles d'évaluation appropriés et reconnus par la pratique, sur la base de la valeur vénale des sous-jacents.

La valeur nette d'inventaire du fonds et la quote-part des différentes classes est déterminée à la valeur vénale.

# Rapport abrégé de la société d'audit selon la loi sur les placements collectifs

à l'attention du Conseil d'administration de la direction de fonds Solutions & Funds SA, Morges

## Rapport abrégé sur l'audit des comptes annuels

### Opinion d'audit

Nous avons effectué l'audit des comptes annuels des fonds de placement Dominicé avec les compartiments :

- US Equities Plus
- European Equities Plus

comprenant le compte de fortune au 31 décembre 2022, le compte de résultat pour l'exercice clos à cette date, les indications relatives à l'utilisation du résultat et à la présentation des coûts ainsi que les informations supplémentaires selon l'art. 89, al. 1, let. b–h de la loi suisse sur les placements collectifs (LPCC).

Selon notre appréciation, les comptes annuels (pages 5 à 15 et 18 à 33) sont conformes à la loi suisse sur les placements collectifs, aux ordonnances y relatives ainsi qu'au contrat de fonds et au prospectus.

### Fondement de l'opinion d'audit

Nous avons effectué notre audit conformément à la loi suisse et aux Normes suisses d'audit des états financiers (NA-CH). Les responsabilités qui nous incombent en vertu de ces dispositions et de ces normes sont plus amplement décrites dans la section « Responsabilités de la société d'audit selon la loi sur les placements collectifs relatives à l'audit des comptes annuels » de notre rapport. Nous sommes indépendants du fonds de placement ainsi que de la direction de fonds, conformément aux dispositions légales suisses et aux exigences de la profession, et avons satisfait aux autres obligations éthiques professionnelles qui nous incombent dans le respect de ces exigences.

Nous estimons que les éléments probants recueillis sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion.

### Autres informations

La responsabilité des autres informations incombe au Conseil d'administration de la direction de fonds. Les autres informations comprennent toutes les informations présentées dans le rapport annuel, à l'exception des comptes annuels et de notre rapport correspondant.

Notre opinion sur les comptes annuels ne s'étend pas aux autres informations et nous n'exprimons aucune conclusion d'audit sous quelque forme que ce soit sur ces informations.

Dans le cadre de notre audit des états financiers, notre responsabilité consiste à lire les autres informations et, ce faisant, à apprécier si elles présentent des incohérences significatives par rapport aux comptes annuels ou aux connaissances que nous avons acquises au cours de notre audit ou si elles semblent par ailleurs comporter des anomalies significatives.

Si, sur la base des travaux que nous avons effectués, nous arrivons à la conclusion que les autres informations présentent une anomalie significative, nous sommes tenus de le déclarer. Nous n'avons aucune remarque à formuler à cet égard.

PricewaterhouseCoopers SA, avenue Giuseppe-Motta 50, case postale, 1211 Genève 2  
Téléphone : +41 58 792 91 00, [www.pwc.ch](http://www.pwc.ch)

## Responsabilités du Conseil d'administration de la direction de fonds relatives aux comptes annuels

Le Conseil d'administration de la direction de fonds est responsable de l'établissement des comptes annuels conformément à la loi suisse sur les placements collectifs, aux ordonnances y relatives ainsi qu'au contrat de fonds et au prospectus. Il est en outre responsable des contrôles internes qu'il juge nécessaires pour permettre l'établissement de comptes annuels ne comportant pas d'anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs.

## Responsabilités de la société d'audit selon la loi sur les placements collectifs relatives à l'audit des comptes annuels

Notre objectif est d'obtenir l'assurance raisonnable que les comptes annuels pris dans leur ensemble ne comportent pas d'anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs, et de délivrer un rapport contenant notre opinion. L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, mais ne garantit toutefois pas qu'un audit réalisé conformément à la loi suisse et aux NA-CH permettra de toujours détecter toute anomalie significative qui pourrait exister. Les anomalies peuvent provenir de fraudes ou résulter d'erreurs et elles sont considérées comme significatives lorsqu'il est raisonnable de s'attendre à ce que, prises individuellement ou dans leur ensemble, elles puissent influencer les décisions économiques que les utilisateurs des comptes annuels prennent en se fondant sur ceux-ci.

Dans le cadre d'un audit conforme à la loi suisse et aux NA-CH, nous exerçons notre jugement professionnel tout au long de l'audit et faisons preuve d'esprit critique. En outre:

- Nous identifions et évaluons les risques que les comptes annuels comportent des anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs, concevons et mettons en œuvre des procédures d'audit en réponse à ces risques, et réunissons des éléments probants suffisants et appropriés pour fonder notre opinion d'audit. Le risque de non-détection d'une anomalie significative provenant de fraudes est plus élevé que celui d'une anomalie significative résultant d'une erreur, car la fraude peut impliquer la collusion, la falsification, des omissions volontaires, de fausses déclarations ou le contournement de contrôles internes.
- Nous acquérons une compréhension du système de contrôle interne de la direction de fonds pertinent pour l'audit afin de concevoir des procédures d'audit appropriées aux circonstances, mais non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du système de contrôle interne du fonds de placement.
- Nous évaluons le caractère approprié des méthodes comptables appliquées et le caractère raisonnable des estimations comptables ainsi que des informations y afférentes.

Nous communiquons au Conseil d'administration de la direction de fonds, notamment l'étendue des travaux d'audit et le calendrier de réalisation prévus et nos constatations d'audit importantes, y compris toute déficience majeure dans le système de contrôle interne, relevée au cours de notre audit.

PricewaterhouseCoopers SA

Marc-Olivier Cadoche  
Expert-réviseur agréé  
Auditeur responsable

Tiphaine Boudart

Genève, le 24 avril 2023