

EUROSE

Document d'information périodique au 28/06/2024

AGENT REPRESENTANT EN SUISSE

REYL & Cie S.A.
4 rue du Rhône - 1204 Genève

AGENT CHARGE DU SERVICE DE PAIEMENT EN SUISSE

REYL & Cie S.A.
4 rue du Rhône - 1204 Genève

Sommaire

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR	3
NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART OU ACTION	4
ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR	5
MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR	6
DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE	7
RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR DEVISE	8
RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR SECTEUR ÉCONOMIQUE	9
RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR	10
VENTILATION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE	11
COMMISSION DE PERFORMANCE	12
INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)	13
OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE	23
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS	24
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS	25
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE	26
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT	27
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS	28
OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	29
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	30
SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE	31
INFORMATIONS POUR LES INVESTISSEURS EN SUISSE	32

EUROSE

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR

Éléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier	2.529.669.205,64
b) Avoirs bancaires	26.701.258,25
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	171.779.922,99
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	2.728.150.386,88
e) Passif	-23.674.643,11
f) Valeur nette d'inventaire	2.704.475.743,77

EUROSE

NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART OU ACTION

Code ISIN de la part	Libellé de la part	Affectation des sommes distribuables	Devise de la part	Actif net de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
FR0007051040	PART CAPI C	Capitalisable	EUR	2.641.591.895,77	6.259.766,2684	421,99
FR0013294311	PART CAPI N	Capitalisable	EUR	30.866.373,12	70.789,6182	436,02
FR0013311537	PART CAPI S	Capitalisable	EUR	32.017.474,88	268.286,1063	119,34

EUROSE

ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR

Eléments du portefeuille titres :	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier	93,54	92,72
b) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen	0,00	0,00
c) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières	0,00	0,00
d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Autres actifs	6,08	6,03

EUROSE

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

Éléments du portefeuille titres :	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
a) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier	592.631.035,78	449.887.002,78
b) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen	0,00	0,00
c) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières	0,00	0,00
d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Autres actifs	180.852.445,30	270.715.590,80

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	773.483.481,08
Cessions	720.602.593,58

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Pas de distribution sur la période.

EUROSE

RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR DEVISE

Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
		Actif net	Total des actifs
Euro	2.529.669.205,64	93,54	92,72
Total	2.529.669.205,64	93,54	92,72

EUROSE

RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR SECTEUR ÉCONOMIQUE

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Banques	23,62	23,41
Souverains	10,79	10,69
Automobiles et équipementiers	5,53	5,49
Construction / Matériaux	5,48	5,43
Compagnies pétrolières	4,15	4,11
Services de soutien aux entreprises	3,81	3,78
Téléphonie fixe	3,60	3,57
Industrie pharmaceutique et Biotechnologie	3,32	3,29
Commerce de détail	3,12	3,09
Matériels et équipements informatiques	2,84	2,81
Industries généralistes	2,43	2,41
Finance générale	2,43	2,41
Chimie	2,39	2,37
Aérospatial / Défense	1,90	1,88
Electricité	1,87	1,85
Gaz eau et autres serv aux collectivités	1,78	1,76
Transport industriel	1,74	1,73
Instr Invest autre que actions	1,57	1,55
Média	1,37	1,36
Ingénierie Industrielle	1,35	1,34
Assurances multirisques	1,19	1,18
Téléphonie mobile	0,89	0,88
Equipements et services de santé	0,79	0,79
Electronique / Equipements électriques	0,69	0,68
Equip serv/distrib prod pétro	0,68	0,67
Produits à usage domestique	0,62	0,61
Alimentation	0,59	0,58
Inv immobilier et serv	0,54	0,54
Equipements / produits domestiques	0,41	0,41
Exploitation minière	0,37	0,37
Banques	0,32	0,32
OPCVM	0,26	0,26
Commerce alimentaire et Pharmacie	0,19	0,19
Voyage et Loisirs	0,19	0,19
Equipements et services médicaux	0,16	0,16
Assurances généralistes	0,15	0,15
SOC PLACEMENT IMMOBILIER	0,13	0,13
Industrie forestière et papier	0,12	0,12
Articles de Loisirs	0,08	0,08
Boissons	0,06	0,06
	0,02	0,02
Total	93,54	92,72

EUROSE

RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	40,52	40,16
Italie	12,69	12,58
Espagne	12,15	12,05
Pays-Bas	5,87	5,82
États-Unis	4,03	4,00
Allemagne	2,70	2,68
Suisse	1,74	1,72
Royaume-Uni	1,67	1,65
Belgique	1,58	1,57
Luxembourg	1,51	1,49
Danemark	1,49	1,48
Tchèque, République	1,32	1,31
Irlande	1,16	1,15
Suède	1,10	1,09
Norvège	1,10	1,09
Autriche	0,97	0,97
Finlande	0,79	0,78
Portugal	0,24	0,23
Grèce	0,22	0,22
Slovénie	0,22	0,22
	0,23	0,22
Caïmanes, Îles	0,13	0,13
Pologne	0,11	0,11
Total	93,54	92,72

EUROSE

VENTILATION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Parts d'OPC	6,08	6,03
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	6,08	6,03
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	0,00	0,00
Autres OPC et fonds d'investissements	0,00	0,00
Autres actifs	0,00	0,00
Total	6,08	6,03

EUROSE

COMMISSION DE PERFORMANCE

PART CAPI C	28/06/2024
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance	0,00

PART CAPI N	28/06/2024
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance	0,00

PART CAPI S	28/06/2024
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance	0,00

EUROSE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Actions et valeurs assimilées			616.455.371,20	22,79
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			616.455.371,20	22,79
Aérospatial / Défense			44.584.500,00	1,65
DASSAULT AVIATION	EUR	126.250	21.412.000,00	0,79
THALES	EUR	155.000	23.172.500,00	0,86
Alimentation			2.247.600,00	0,08
CORBION	EUR	120.000	2.247.600,00	0,08
Assurances multirisques			20.685.900,00	0,76
COFACE	EUR	1.590.000	20.685.900,00	0,76
Automobiles et équipementiers			24.223.750,00	0,90
D'IETEREN GROUP	EUR	12.000	2.377.200,00	0,09
MICHELIN	EUR	605.000	21.846.550,00	0,81
Banques			111.229.800,00	4,11
BNP PARIBAS ACTIONS A	EUR	840.000	50.005.200,00	1,85
CREDIT AGRICOLE	EUR	2.070.000	26.371.800,00	0,97
SOCIETE GENERALE	EUR	1.590.000	34.852.800,00	1,29
Chimie			35.159.040,00	1,30
AIR LIQUIDE PRIME DE FIDELITE	EUR	218.000	35.159.040,00	1,30
Commerce de détail			7.526.000,00	0,28
ALD	EUR	1.200.000	6.498.000,00	0,24
SIXT PREF.	EUR	20.000	1.028.000,00	0,04
Compagnies pétrolières			88.196.950,00	3,26
TOTALENERGIES SE	EUR	1.415.000	88.196.950,00	3,26
Construction / Matériaux			83.812.500,00	3,10
BOUYGUES	EUR	1.270.000	38.061.900,00	1,41
SAINT-GOBAIN	EUR	630.000	45.750.600,00	1,69
Electricité			12.427.800,00	0,46
NEOEN	EUR	330.000	12.427.800,00	0,46
Equipements et services de santé			4.934.631,20	0,18
ESSILORLUXOTTICA	EUR	24.526	4.934.631,20	0,18
Equip serv/distrib prod pétro			3.101.150,00	0,11
CGG RGPT	EUR	6.500.000	3.101.150,00	0,11
Gaz eau et autres serv aux collectivités			16.193.600,00	0,60
VEOLIA ENVIRONNEMENT	EUR	580.000	16.193.600,00	0,60
Industrie pharmaceutique et Biotechnologie			49.467.000,00	1,83
SANOFI	EUR	550.000	49.467.000,00	1,83
Matériels et équipements informatiques			48.299.950,00	1,79
EUTELSAT COMMUNICATIONS	EUR	2.750.000	10.329.000,00	0,38
STMICROELECTRONICS	EUR	1.030.000	37.970.950,00	1,41
Média			27.416.900,00	1,01
M6 - METROPOLE TELEVISION	EUR	600.000	7.044.000,00	0,26
PUBLICIS GROUPE	EUR	205.000	20.372.900,00	0,75
Téléphonie fixe			36.948.300,00	1,37
ORANGE	EUR	3.950.000	36.948.300,00	1,37

EUROSE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Obligations			1.913.213.834,44	70,74
Obligations convertibles en actions négociées sur un marché réglementé			62.294.434,48	2,30
Articles de Loisirs			2.047.752,90	0,08
UBISOFT 0%19-240924 OCEANE	EUR	18.075	2.047.752,90	0,08
Banques			10.305.740,20	0,38
AIB 6 1/4 PERP	EUR	1.200	1.203.428,26	0,04
CAIXABANK TV20-PERP.COCO	EUR	24	4.773.780,92	0,18
UNICREDIT TV19-PERP SUB.	EUR	4.200	4.328.531,02	0,16
Commerce de détail			3.603.985,83	0,13
FNAC DARTY OC 0,25%23032027	EUR	50.309	3.603.985,83	0,13
Electronique / Equipements électriques			0,00	0,00
SUFP 1 5/8 06/28/31	EUR	0,00	0,00	0,00
Equipements / produits domestiques			4.483.486,05	0,17
NEXITY 0,875%21-190428 OCEANE	EUR	133.449	4.483.486,05	0,17
Equipements et services de santé			3.090.110,40	0,11
KORIAN 0,875%20-060327 OCEANE	EUR	62.400	3.090.110,40	0,11
Matériels et équipements informatiques			9.855.248,00	0,36
AMS-OSRAM 0%18-050325 CV	EUR	52	9.855.248,00	0,36
Services de soutien aux entreprises			24.683.318,76	0,91
EDENFP 0 09/06/24	EUR	55.000	3.334.045,00	0,12
NEXI 0%24022028	EUR	83	7.086.872,00	0,26
NEXI 1,75%20-240427 CV	EUR	9	835.712,26	0,03
WORLDLINE 0%19-300726 OCEANE	EUR	38.500	3.566.139,50	0,13
WORLDLINE 0%20-300725 OCEANE	EUR	87.500	9.860.550,00	0,37
Téléphonie fixe			4.224.792,34	0,16
CELLNEX 0,75%20-201131 CV	EUR	51	4.224.792,34	0,16
Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			1.848.730.879,14	68,36
Aérospatial / Défense			6.806.721,15	0,25
THALES 4,125%23-181028 EMTN	EUR	65	6.806.721,15	0,25
Alimentation			13.628.444,34	0,50
BARY 4 06/14/29	EUR	63	6.329.752,40	0,23
BEL 4,375%24-110429	EUR	39	3.968.713,19	0,15
SUEDZUCKER INT FIN 5,125%22-27	EUR	31	3.329.978,75	0,12
Assurances généralistes			3.982.864,49	0,15
SOGECAP TV23-160544	EUR	37	3.982.864,49	0,15
Assurances multirisques			11.513.902,44	0,43
BFCM 5 10/30/44	EUR	45	4.471.454,51	0,17
COFACE 5,75%23-281133	EUR	37	4.062.198,66	0,15
ETHIAS 6,75%23-050533	EUR	27	2.980.249,27	0,11
Automobiles et équipementiers			125.445.087,60	4,64
F 4.165 11/21/28	EUR	3.800	3.813.488,13	0,14
FORD MOT 1,744%24	EUR	13.000	13.200.329,29	0,49
FORD MOTOR 4,867% 030827	EUR	4.800	5.139.094,56	0,19
FORD MOTOR CRED 6,125%23-0528	EUR	7.600	8.193.672,44	0,30

EUROSE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
FORVIA 2,75%21-150227	EUR	5.900	5.651.070,81	0,21
FORVIA 3,125%19-150626	EUR	2.000	1.958.651,39	0,07
FORVIA 5,5%24-150631	EUR	5.200	5.261.605,56	0,20
GENERAL MOTORS 1%22-240225	EUR	5.800	5.717.782,62	0,21
GENERAL MOTORS 3,9%24 120128	EUR	2.800	2.861.734,03	0,11
IHO VERWALTUNGS TV16-150926	EUR	3.700.000	3.668.682,58	0,14
MERCEDESBENZ 3%24-100727	EUR	4.800	4.823.243,02	0,18
RENAULT 1,125%19-041027 EMTN	EUR	21	1.927.129,38	0,07
RENAULT 1,25%19-240625	EUR	40	3.894.055,89	0,14
RENAULT 2,375%20-250526	EUR	62	6.021.642,14	0,22
RENAULT TPA 83-84	EUR	11.711	3.864.630,00	0,14
SCHAEFFLER 4,75%24-140829	EUR	22	2.266.732,73	0,08
STELLANTIS 2,75%20-150526	EUR	54	5.340.310,77	0,20
STELLANTIS 2%18-200325	EUR	117	11.620.540,97	0,43
VOLVO CAR 2,5%20-071027	EUR	4.100	3.969.145,70	0,15
VOVCAB 4 3/4 05/08/30	EUR	4.100	4.140.210,89	0,15
ZF EU FINANCE 2%19-230226	EUR	46	4.460.177,60	0,17
ZF EU FINANCE 6,125%23-130329	EUR	26	2.801.751,45	0,10
ZF FIN 2,75%20-250527	EUR	33	3.152.796,95	0,12
ZF FIN 2%21-060527	EUR	56	5.253.658,41	0,19
ZF FIN 3%20-210925	EUR	20	2.018.301,31	0,08
ZF FIN 5,75%23-030826	EUR	41	4.424.648,98	0,16
Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			512.840,00	0,02
FLTR 5 04/29/29	EUR	500	512.840,00	0,02
Banques			8.736.067,75	0,32
BANQUE POSTALE TV22-0334 EMTN	EUR	54	5.672.762,14	0,21
BANQUE POSTALE TV22-090228	EUR	33	3.063.305,61	0,11
AIB GRP TV20-300531	EUR	9.400	9.140.177,56	0,34
BANCO BPM 1,75%19-280125	EUR	1.700	1.691.362,33	0,06
BANCO BPM 4,625%23-291127	EUR	3.200	3.364.688,26	0,13
BANCO BPM 6%22-130926	EUR	5.200	5.672.122,49	0,21
BANCO BPM TV20-140930 EMTN	EUR	6.600	6.870.340,69	0,25
BANCO BPM TV23-140628	EUR	7.800	8.211.675,45	0,30
BANCO SABADELL 5,625%16-060526	EUR	78	8.125.449,12	0,30
BANCO SABADELL TV22-240326	EUR	16	1.597.490,85	0,06
BANCO SABADELL TV23-070229	EUR	34	3.601.730,92	0,13
BANCO SABADELL TV23-080929EMTN	EUR	41	4.505.003,83	0,17
BANCO SABADELL TV24-130930	EUR	17	1.738.384,89	0,06
BANCO SANTANDER 3,5%24-090128	EUR	75	7.595.212,30	0,28
BANCO SANTANDER TV20-110225	EUR	59	5.950.317,17	0,22
BANCO SANTANDER TV23-181027	EUR	118	12.397.109,02	0,46
BANCO SANTANDER TV23-230833	EUR	44	4.805.770,64	0,18
BANK OF AMERICA 4,134%23-0628	EUR	6.900	7.056.182,92	0,26
BANQUE STELL 3,875%23-190126	EUR	19	1.937.352,60	0,07
BARCLAYS TV22-310127	EUR	3.900	3.896.217,96	0,14

EUROSE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
BBVA 0,125%21-240327	EUR	55	5.184.038,56	0,19
BBVA TV20-160130 GLOB.MTN SUB	EUR	72	7.086.457,18	0,26
BBVA TV20-PERP. REGS CV	EUR	16	3.229.622,86	0,12
BBVA TV23-100526	EUR	55	5.548.343,49	0,21
BCO CREDITO SOC TV22-220926	EUR	27	2.994.857,56	0,11
BCO SABADELL TV24-150130	EUR	39	4.008.146,79	0,15
BELFIUS BANQUE 3,75%24-0129	EUR	42	4.266.815,11	0,16
BNP PARIBAS 1,5%16-250528 EMTN	EUR	1.000	929.881,64	0,03
BNP PARIBAS TV19-230127	EUR	88	8.649.059,56	0,32
BNP PARIBAS TV20-010928	EUR	98	8.883.275,33	0,33
CA AUTO BK 4,375%23-080626	EUR	8.700	8.822.815,40	0,33
CA AUTO BK 4,75%23-250127	EUR	4.400	4.596.703,08	0,17
CA AUTO BK TV23-130125	EUR	7.500	7.604.585,00	0,28
CAIXABANK TV20-181126	EUR	35	3.346.825,37	0,12
CAIXABANK TV21-180631	EUR	86	8.117.535,29	0,30
CAIXABANK TV22-130426	EUR	53	5.229.412,71	0,19
CAIXABANK TV22-230233	EUR	71	7.633.916,12	0,28
CAIXABANK TV24-090232	EUR	98	9.986.489,18	0,37
CESKA SPORITELNA TV22-141125	EUR	59	6.200.207,96	0,23
CESKA SPORITELNA TV23-080328	EUR	34	3.575.007,04	0,13
CESKA SPORITELNA TV23-290627	EUR	47	4.845.504,79	0,18
CESKA SPORITELNA TV24-150130	EUR	28	2.906.693,31	0,11
CESSPO 4.57 07/03/31	EUR	27	2.692.251,00	0,10
COOP RABOBANK TV22-301132	EUR	31	3.146.664,23	0,12
CREDEM TV23-300529	EUR	4.900	5.176.828,52	0,19
CREDIT AGRICOLE 2,5%22-290829	EUR	57	5.525.798,03	0,20
CREDIT AGRICOLE SA 4% 10/12/2026	EUR	59	6.081.793,51	0,23
DNB BANK TV23-160227	EUR	7.200	7.286.464,72	0,27
DNB BK ASA TV23-011129	EUR	6.600	7.047.832,00	0,26
ERSTBK 1 5/8 09/08/31	EUR	24	2.299.034,10	0,09
IBERCAJA BANCO TV23-070627	EUR	39	4.041.775,68	0,15
IBERCAJA BANCO TV24-300728	EUR	26	2.673.888,02	0,10
ING GROUP TV20-260531	EUR	50	4.820.220,55	0,18
ING GROUP TV21-290928	EUR	36	3.248.597,21	0,12
INTESA SANPA 0,625%21-240226	EUR	4.200	3.993.918,05	0,15
INTESA SANPAOLO 1,75%18-200328	EUR	2.700	2.536.046,01	0,09
INTESA SANPAOLO TV17-PERP.	EUR	7.300	7.771.753,68	0,29
INTESA SANPAOLO TV19-120729	EUR	7.200	7.507.689,44	0,28
INTESA SANPAOLO TV23-170325	EUR	10.300	10.344.929,46	0,38
JYSKE BANK 5,5%22-161127	EUR	5.000	5.357.612,84	0,20
JYSKE BANK TV21-020926	EUR	6.500	6.216.829,45	0,23
JYSKE BANK TV23-101129	EUR	5.200	5.533.794,39	0,21
JYSKE BANK TV23-261028	EUR	4.900	5.219.445,73	0,19
KBCBB 2 7/8 06/29/25	EUR	61	6.099.878,00	0,23
KBCBB 4 1/2 06/06/26	EUR	105	10.593.087,53	0,39

EUROSE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
LLOYDS BANK GRP TV24-050327	EUR	2.100	2.114.997,15	0,08
MORGAN STANLEY TV24-190327	EUR	5.900	5.924.454,35	0,22
NATIONWIDE BUILD 4,5%23-011126	EUR	3.200	3.362.368,00	0,12
NATL BANK GREECE TV24-290129	EUR	5.900	6.011.022,52	0,22
NATWEST MKTS TV23-130126	EUR	8.700	8.881.450,10	0,33
NLB TV23-270627	EUR	17	1.787.696,25	0,07
NORDEA BK TV23-060926	EUR	5.851	6.099.320,28	0,23
NOVALJ 4 1/2 05/29/30	EUR	30	2.999.555,34	0,11
NOVA LJUBLJANSK 240134	EUR	11	1.181.053,11	0,04
RCIB 4,125%22-011225 EMTN	EUR	1.800	1.848.543,93	0,07
RCI BANQUE 4,125%24-040431	EUR	6.200	6.227.764,96	0,23
RCI BANQUE 4,875%23-021029	EUR	4.900	5.256.454,92	0,19
RCI BANQUE 4,875%23-140628	EUR	3.900	4.033.669,03	0,15
RCI BQ 4,625%23-130726 EMTN	EUR	3.400	3.596.825,91	0,13
RCI TV19-180230 EMTN	EUR	128	12.729.502,43	0,47
RENAUL 5 1/2 10/09/34	EUR	53	5.290.672,00	0,20
SG TV21 12062029 EMTN	EUR	107	9.338.788,51	0,35
SOC.GEN. TV21-300631 EMTN	EUR	73	6.822.519,00	0,25
SOCGEN TV20-241130 EMTN	EUR	35	3.358.663,88	0,12
SOCIETEGENERALE TV23-280929	EUR	71	7.542.537,57	0,28
SPBK 1 SR BANK 3,625% 12032029	EUR	6.500	6.588.746,37	0,24
SRBANK 3 3/8 11/14/29	EUR	8.800	8.746.482,29	0,32
UBS GROUP TV22-131026	EUR	9.100	9.031.566,26	0,33
UNICAJA BANCO 4,5%22-300625	EUR	25	2.499.900,00	0,09
UNICAJA BANCO TV19-131129	EUR	53	5.344.223,43	0,20
UNICAJA BANCO TV21-011226	EUR	24	2.315.992,79	0,09
UNICRE BK CZ SK 3,625%23-0226	EUR	95	9.604.481,31	0,36
UNICREDIT BANK TV19-230929 676	EUR	11.100	11.192.512,74	0,41
UNICREDIT MTN 0729	EUR	4.600	4.135.742,36	0,15
UNICREDIT TV19-030725	EUR	1.400	1.422.603,84	0,05
UNICREDIT TV24-160434	EUR	4.700	4.887.074,63	0,18
Boissons			1.498.539,00	0,06
PICSUR 6 3/8 07/01/29	EUR	1.500	1.498.539,00	0,06
Chimie			29.528.844,70	1,09
ARKEMA TV19-PERP.	EUR	78	7.946.518,95	0,29
GRUENENTHAL 4,125%21-150528	EUR	5.000	4.916.677,08	0,18
GRUENENTHAL 6,75%23-150530	EUR	1.900	2.015.125,75	0,08
INEOS FINANCE 6,375%24-150429	EUR	1.800	1.900.152,59	0,07
INEOS FINANCE 6,625% 15052028	EUR	2.000	2.085.258,61	0,08
PPG INDUSTRIES 1,875%22-010625	EUR	3.100	3.051.337,64	0,11
SOLVAY 2,5% PERP	EUR	45	4.384.062,74	0,16
SOLVAY 3,875%24-030428	EUR	32	3.229.711,34	0,12
Commerce alimentaire et Pharmacie			5.263.555,28	0,19
CARREFOUR 1 875 301026	EUR	54	5.263.555,28	0,19

EUROSE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Commerce de détail			73.297.823,99	2,71
ALD 041028	EUR	73	7.858.399,74	0,29
ALD 4,75%22-131025	EUR	39	4.072.038,80	0,15
ALD TV23-210225	EUR	42	4.233.726,00	0,16
CRTING 4 1/4 06/26/31	EUR	25	2.502.071,58	0,09
FNAC DARTY 6%24-010429	EUR	5.400	5.580.779,61	0,21
LEASYS 4,5%23-260726	EUR	6.100	6.428.114,00	0,24
LEASYS 4,625%23-160227	EUR	3.600	3.736.015,77	0,14
LEASYS EMTN 3,875% 01032028	EUR	2.300	2.322.466,90	0,09
SCANIA CV AB 2,25%20-030625	EUR	9.500	9.379.137,88	0,35
SIXT 1,25%20-091224	EUR	6.000	5.999.518,36	0,22
SIXT 5,125%23-091027	EUR	9.300	10.074.385,84	0,37
SIXT SE 250129	EUR	2.500	2.552.552,46	0,09
VERISURE 3,25% 15 02 2027	EUR	3.100	3.021.997,97	0,11
VERISURE HOLD 3,875%20-150726	EUR	3.900	3.929.272,21	0,14
VERISURE HOLD 7,125%23-010228	EUR	1.500	1.607.346,87	0,06
Compagnies pétrolières			24.030.153,80	0,89
ENI TV20-PERP. NC5	EUR	5.400	5.322.047,46	0,20
GALP ENERGIA 2%20-150126	EUR	65	6.376.272,32	0,23
NATL GRID 4,151%23-120927	EUR	5.600	5.864.790,95	0,22
REPSOL INTL TV15-250375 SENIOR	EUR	6.400	6.467.043,07	0,24
Construction / Matériaux			64.383.877,32	2,38
ARCADIS 4,785%28022028	EUR	4.600	4.815.186,11	0,18
CIE DE SAINT-GOBAIN 3,75%23-26	EUR	95	9.754.800,90	0,36
EIFFAGE 1,625%20-140127	EUR	53	5.072.088,42	0,19
IPGIM 5 3/8 06/20/29	EUR	5.400	5.376.548,47	0,20
OHL OPRCNS TV21-310326	EUR	1.043.877	1.039.822,14	0,04
SPIE 2.625%19-180626	EUR	158	15.406.688,22	0,57
WEBUILD 3,875%22-280726	EUR	6.500	6.655.072,24	0,24
WEBUILD 7%23-270928	EUR	6.000	6.689.043,93	0,25
WIENERBERGER 2,75%20-040625	EUR	63	6.236.052,41	0,23
WIENERBERGER 4,875%23-041028	EUR	3.100	3.338.574,48	0,12
Electricité			38.065.816,54	1,41
DRAX FINC 2,625%20-011125	EUR	8.105	7.920.432,26	0,29
EDF 3,75%23-050627 EMTN	EUR	65	6.544.095,82	0,24
EDF 5%14-PERPETUEL EMTN	EUR	11	1.117.348,26	0,04
EDF TV13-PERPETUEL EMTN	EUR	62	6.339.518,46	0,24
EDF TV18-PERP.	EUR	77	7.927.895,18	0,29
ENEL FIN INTL 0,25%22-171125	EUR	4.000	3.834.909,51	0,14
ENEL TV19-240580	EUR	2.000	1.988.939,45	0,08
ERGIM 4 1/8 07/03/30	EUR	2.400	2.392.677,60	0,09
Electronique / Equipements électriques			18.584.720,59	0,69
ALOPF 5.868 PERP	EUR	23	2.350.510,64	0,09
CARRIER 4,375%25	EUR	5.300	5.343.965,32	0,20
NEXANS 050428	EUR	36	3.793.356,99	0,14

EUROSE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
REXEL 2,125%21-150628	EUR	3.400	3.141.679,81	0,11
REXEL 5,25%23-150930	EUR	3.800	3.955.207,83	0,15
Equipements / produits domestiques			6.651.030,63	0,25
SEB 1,375%20-160625	EUR	68	6.651.030,63	0,25
Equipements et services de santé			13.391.845,10	0,49
AMPLIFON 1,125%20-130227	EUR	3.700	3.468.244,13	0,13
FRESENIUS 1,875% 240525	EUR	2.000	1.970.666,85	0,07
FRESENIUS FIN 0%21-011025	EUR	3.900	3.731.325,00	0,14
GN STORE NORD 0,875%21-251124	EUR	4.300	4.221.609,12	0,15
Equipements et services médicaux			4.236.897,49	0,16
SARTORIUS FIN 4,375%23-140929	EUR	40	4.236.897,49	0,16
Equip serv/distrib prod pétro			15.215.628,80	0,56
CGG 7,75 % 2027	EUR	5.100	5.008.334,58	0,19
SAIPEM FIN INT 3,125%21-310328	EUR	4.300	4.183.609,01	0,15
SPMIM 4 7/8 05/30/30	EUR	6.000	6.023.685,21	0,22
Exploitation minière			10.078.970,75	0,37
IMERYYS 4,75%23-291129	EUR	96	10.078.970,75	0,37
Finance générale			65.832.484,77	2,43
ARVAL SERV LEAS 0%21-011025	EUR	11	1.047.739,00	0,04
ARVAL SERV LEAS 4,625%23-1224	EUR	46	4.733.841,52	0,18
ARVAL SERV LEAS 4% 220926	EUR	64	6.619.508,81	0,24
AVIS BUDGET 7,25%23-310730	EUR	4.100	4.163.243,64	0,15
AVIS BUDGET 7% 280229	EUR	5.700	5.745.321,33	0,21
BANCA IFIS 5,5%24-270229	EUR	2.100	2.161.581,30	0,08
BANCA IFIS 6,125%23-190127	EUR	4.300	4.571.513,63	0,17
CROWN EURO.HOLDINGS 5%23-0528	EUR	4.400	4.544.794,22	0,17
EC FINANCE 3%15102026	EUR	5.200	5.074.090,67	0,19
LEASEPLAN 0,25%21-230226 MTN	EUR	4.000	3.789.431,91	0,14
PAPREC HOLDING 3,5%21-010728	EUR	4.600	4.430.461,89	0,16
PAPREC HOLDING 6,5%23-171127	EUR	4.200	4.432.365,00	0,16
SPCM 2%20-010226	EUR	6.100	5.923.703,67	0,22
TDF INF INDX RTG 16-070426	EUR	17	1.674.653,70	0,06
TDF INFRASTR. 5,625%23-210728	EUR	63	6.920.234,48	0,26
Gaz eau et autres serv aux collectivités			31.905.160,88	1,18
E.ON 3,75%23-010329	EUR	3.650	3.755.985,00	0,14
ENGIE 3,75%23-060927	EUR	48	4.972.740,98	0,18
HLDG INF MET ENV 0,625%21-28	EUR	6.400	5.478.797,99	0,20
HLD INF MET ENV 0,125% 160925	EUR	7.000	6.669.603,06	0,25
HLD INF MET ENV 4,5%06042027	EUR	7.900	7.944.682,62	0,29
IBERDROLA INTL TV20-PERP. NC5	EUR	32	3.083.351,23	0,12
Industrie forestière et papier			3.263.080,67	0,12
STORA ENSO 4,25%23-010929 EMTN	EUR	3.100	3.263.080,67	0,12
Industrie pharmaceutique et Biotechnologie			40.343.800,22	1,49
CHEPLAPHARM ARZ 4,375%20-0128	EUR	5.000	4.860.525,69	0,18
CHEPLAPHARM ARZ 7,5%23-150530	EUR	2.000	2.114.463,33	0,08

EUROSE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
GRIFOLS 1,625%19-150225	EUR	5.100	5.091.656,54	0,19
GRIFOLS 2,25%19-151127	EUR	3.900	3.510.341,25	0,13
GRIFOLS 3,875%21-151028	EUR	3.700	3.071.511,32	0,11
H LUNDBECK 0,875%20-141027	EUR	5.900	5.401.648,60	0,20
TEVA PHARMAC 6%20-310125	EUR	5.100	5.254.139,00	0,19
TEVA PHARMAC 7,375%23-150929	EUR	3.500	3.957.660,49	0,15
TEVA PHARMA FIN IIS,75%21-0527	EUR	7.200	7.081.854,00	0,26
Industries généralistes			65.806.710,99	2,43
ABERTIS 3,248% PERP	EUR	59	5.823.169,43	0,22
AHLSTROM HLDG 3,625%21-040228	EUR	2.700	2.573.702,62	0,09
ARDAGH MTL PACK 3%21-010929	EUR	7.600	6.186.906,67	0,23
BALL 1,5%150327	EUR	4.700	4.399.203,58	0,16
CANPACK 2,375%20-011127	EUR	3.100	2.925.948,35	0,11
HUHTAMAKI 4,25%22-090627	EUR	36	3.607.769,10	0,13
HUHTAMAKI 5,125% 24112028	EUR	24	2.550.254,49	0,09
ORANO 3,375%19-230426	EUR	121	12.077.283,49	0,45
ORANO 4%24-120331 EMTN	EUR	38	3.813.049,10	0,14
ORANO SA 15052027	EUR	92	9.587.858,14	0,35
SIG COMB PURCH 2,125%20-180625	EUR	7.900	7.752.333,64	0,29
VERALLIA 1,625%21-140528	EUR	49	4.509.232,38	0,17
Ingénierie Industrielle			36.489.767,18	1,35
EPIROC 3,625%24-280231	EUR	3.700	3.704.626,72	0,14
KION GROUP 1,625%20-240925	EUR	42	4.144.520,07	0,15
TRATON FINANCE LUXE 4,5%30112028	EUR	44	4.579.586,36	0,17
TRATON FIN LUX 3,75%24-270330	EUR	43	4.286.651,74	0,16
TRATON FIN LUX 4,125%22-221125	EUR	17	1.746.636,43	0,06
TRATON FIN LUX 4,125%23-180125	EUR	80	8.154.792,13	0,30
TRATON FIN LUX TV23-210126	EUR	66	6.688.822,62	0,25
VERDE BIDCO 4,625%21-011026	EUR	3.200	3.184.131,11	0,12
Instr Invest autre que actions			42.364.410,85	1,57
CASTELLUM 2%22-240325	EUR	3.300	3.259.375,19	0,12
CREDEM HOLD.TV20-161230	EUR	300	300.096,02	0,01
DUFY ONE 4,75%24-180431	EUR	8.500	8.539.133,06	0,32
EMERALD DEBT 6,375%23-151230	EUR	3.400	3.544.535,42	0,13
ING 4,125%23-021026	EUR	100	10.459.111,48	0,39
LOUIS COMPANY. 1,625%21-280428	EUR	5.400	5.015.702,71	0,18
NOVELIS SH IN 3,375%21-150429	EUR	800	761.063,00	0,03
VZ VEND FIN 2,875%20-150129	EUR	5.025	4.378.781,51	0,16
WIZZ AIR FIN CO 1%22-190126	EUR	6.400	6.106.612,46	0,23
Inv immobilier et serv			14.675.745,36	0,54
HARLEY DAVIDS FIN 5,125%23-26	EUR	4.700	4.855.034,97	0,18
ILDFF 6 7/8 04/15/31	EUR	7.900	8.094.708,67	0,30
ILIAD 5,125%21-151026	EUR	1.704	1.726.001,72	0,06
Matériels et équipements informatiques			18.575.336,78	0,69
AMS-OSRAM 10,5%23-300329	EUR	4.300	4.623.374,33	0,17

EUROSE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
CETIN GRP 3,125%22-140427	EUR	6.000	5.886.982,19	0,22
INFINEON TECHNOLOG TV19-PERP.	EUR	81	8.064.980,26	0,30
Média			9.752.450,76	0,36
IPSOS 2,875%18-210925	EUR	97	9.752.450,76	0,36
OPCVM			7.034.359,07	0,26
KUTXAB 4 3/4 06/15/27	EUR	69	7.034.359,07	0,26
Produits à usage domestique			16.704.974,45	0,62
COTY 3,875%21-150426	EUR	2.100	2.108.942,21	0,08
COTY 4 1/2 05/15/27	EUR	2.300	2.330.521,00	0,09
COTY 5,75%23-150928	EUR	6.400	6.785.089,78	0,25
ONTEX GROUP 3,5%21-150726	EUR	2.600	2.613.223,89	0,10
TAPESTRY 5,375%23-271127	EUR	2.700	2.867.197,57	0,10
Services de soutien aux entreprises			76.178.405,00	2,82
DERICHEBOURG 2,25%21-150728	EUR	6.700	6.180.197,25	0,23
ELIS 1,625%19-030428	EUR	33	3.032.161,60	0,11
ELIS 1%19-030425	EUR	38	3.725.313,86	0,14
ELIS 2,875%18-150226 EMTN	EUR	27	2.686.041,44	0,10
ELIS 4,125%22-240527	EUR	37	3.722.116,88	0,14
FCC ME AMBIENTE 1,661%19-1226	EUR	4.300	4.153.351,55	0,15
FCC SERVICIOS MEDIO REGS 301029	EUR	7.700	8.417.154,02	0,31
IQVIA 2,25%-150128	EUR	6.300	5.939.813,25	0,22
IQVIA 2,25%21-150329	EUR	1.500	1.369.916,25	0,05
IQVIA 2,875%17-150925	EUR	3.200	3.183.728,44	0,12
LOXAM 2,875%19-150426	EUR	4.200	4.102.760,08	0,15
LOXAM 6,375%23-150528	EUR	6.900	7.163.876,13	0,27
LOXAM VAR 4,5%15022027	EUR	2.800	2.825.130,00	0,10
NEXI 1,625%21-300426	EUR	7.600	7.280.029,44	0,27
NEXI 2,125%21-300429	EUR	4.100	3.729.850,86	0,14
SMURFIT KAP ACQ 2,875%18-0126	EUR	2.650	2.651.767,03	0,10
TELEPERFORMANCE	EUR	57	6.015.196,92	0,22
SOC PLACEMENT IMMOBILIER			3.486.369,50	0,13
UPCB FINANCE 3,625%17-150629	EUR	3.600	3.486.369,50	0,13
Souverains			291.748.411,26	10,79
ESPAGNE 1,8%14-301124 INDX	EUR	15.500	19.645.119,63	0,73
ESPANA 1%15-301130 INDX	EUR	28.000	35.055.674,44	1,29
ITALIE TV22 221128 INFLATION	EUR	23.200	22.469.395,08	0,83
ITALIE TV23-150529 INFLATION	EUR	34.200	35.103.435,41	1,30
ITALY TV14-150924 INFLATION	EUR	39.600	50.233.541,44	1,86
ITALY TV20-150526 INFLATION	EUR	30.100	35.164.611,37	1,30
OAT 1,00%15-25112025	EUR	22.000.000	21.468.500,44	0,79
SPAIN 0%22-310525	EUR	17.500	16.957.325,00	0,63
SPAIN TV17-301127 INDX	EUR	45.100	55.650.808,45	2,06
Téléphonie fixe			56.244.476,62	2,08
EIRCOM 5 3/4 12/15/29	EUR	3.000	3.013.855,83	0,11
EIRCOM FINANCE 1,75%19-011124	EUR	1.700	1.692.392,97	0,06

EUROSE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
EIRCOM FINANCE 3,5%19-150526	EUR	3.400	3.330.808,11	0,12
ILDFP 5 3/8 05/02/31	EUR	56	5.697.288,11	0,21
ILIAD 1,875%21-110228	EUR	57	5.228.636,16	0,19
ILIAD 2,375%20-170626	EUR	43	4.159.888,92	0,15
ILIAD JUNE2027 EUR	EUR	94	9.598.346,44	0,36
INWIT 1,875%20-080726	EUR	6.800	6.685.097,84	0,25
PPF TELECOM GP 2,125%19-310125	EUR	10.700	10.674.461,20	0,40
PPF TELECOM GRP 3,25%20-290927	EUR	1.500	1.496.005,49	0,06
TELECOM ITALIA 2,75%19-150425	EUR	4.700	4.667.695,55	0,17
Téléphonie mobile			24.039.700,76	0,89
CELLNEX FIN.0,75%151126	EUR	63	5.925.925,62	0,22
CELLNEX FINANCE 1%21-150927	EUR	36	3.335.726,95	0,12
CELLNEX FINANCE 2,25%22-120426	EUR	65	6.376.000,48	0,24
TDCDC 5.186 08/02/29	EUR	5.800	5.941.945,33	0,22
TDC NET 5,056%22-310528	EUR	2.400	2.460.102,38	0,09
Transport industriel			47.188.130,33	1,74
AIR LEASE 3,7%24-150430	EUR	5.500	5.433.267,67	0,20
GETLINK 3,5%20-301025	EUR	15.400	15.281.026,44	0,56
INPOST 2,25%150727	EUR	7.900	7.524.967,25	0,28
LOUIS DR COMP 2,375%20-271125	EUR	13.900	13.798.893,83	0,51
MUNDYS SA 4,75%29	EUR	5.000	5.149.975,14	0,19
Voyage et Loisirs			5.047.372,19	0,19
ACCOR 2,625%19-PERP.	EUR	51	5.047.372,19	0,19
Autres obligations et valeurs assimilées non négociées sur un marché réglementé			2.188.520,82	0,08
Services de soutien aux entreprises			2.188.520,82	0,08
ELIS 3,75%24-210330	EUR	22	2.188.520,82	0,08
Parts d'OPC et fonds d'investissements			164.393.873,95	6,08
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne			164.393.873,95	6,08
OPCVM			154.019.173,95	5,70
DNCA CREDIT CONVICT.IC EUR 4D	EUR	50.000	8.415.500,00	0,31
DNCA INV.FLEX INFLATION I 4DEC	EUR	40.000	4.841.600,00	0,18
DNCA INVES.MIURI EUR CL.I C.4D	EUR	250.000	35.772.500,00	1,32
DNCA OPPORTUNITES ZONE EU-F	EUR	185.000	24.741.900,00	0,92
DNCA SRI HIGH YIELD IC EUR 4D	EUR	210.000	20.265.000,00	0,75
OSTRUM SRI MONEY PLUS-IC EUR	EUR	555	59.982.673,95	2,22
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne			10.374.700,00	0,38
DNCA ENGAGE-I EUR	EUR	70.000	10.374.700,00	0,38
Total			2.694.063.079,59	99,61

EUROSE

OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE

Libellé instrument	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)			
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)	
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)
Total	0,00	0,00		0,00		0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

EUROSE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS

Instruments financiers à terme – actions				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

EUROSE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS

Instruments financiers à terme – taux d'intérêts				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

EUROSE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE

Instruments financiers à terme – de change				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

EUROSE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT

Instruments financiers à terme – sur risque de crédit				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

EUROSE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS

Instruments financiers à terme – autres expositions				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
CAC40-EOP 0724	-900,00	1.271.340,00	0,00	-67.314.600,00
STX50E-EUX 0924	-1.980,00	623.301,98	0,00	-96.901.596,00
Sous total		1.894.641,98	0,00	-164.216.196,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		1.894.641,98	0,00	-164.216.196,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

EUROSE

OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)

Libellé instrument	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)				Classe de part couverte
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)		
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)	
Total	0,00	0,00		0,00		0,00	

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

EUROSE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)

Libellé instrument	Quantité/ Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)	Classe de part couverte
		Actif	Passif	+/-	
Futures					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Options					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Swaps					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Autres instruments					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Total		0,00	0,00	0,00	

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

EUROSE

SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	2.694.063.079,59
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	0,00
Total instruments financiers à terme - actions	0,00
Total instruments financiers à terme - taux	0,00
Total instruments financiers à terme - change	0,00
Total instruments financiers à terme - crédit	0,00
Total instruments financiers à terme - autres expositions	1.894.641,98
Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises	0,00
Autres actifs (+)	32.192.665,31
Autres passifs (-)	-23.674.643,11
Passifs de financement (-)	-
Total = actif net	2.704.475.743,77

INFORMATIONS POUR LES INVESTISSEURS EN SUISSE

TER ET PTR

Le « Total Expense Ratio » (TER) est défini comme étant le rapport entre les charges d'exploitation totales et la fortune moyenne du Fonds exprimée en devise du fonds.

Au 30 juin 2024, le TER est de :

- Part C : +1,53% ;
- Part N : +1,02%
- Part S : + 0,33% ;

Le « Portfolio Turnover Ratio » (PTR) est défini comme étant le taux de rotation du portefeuille. Il se calcule de la manière suivante :

$((\text{Total des achats de titres} + \text{Total des ventes de titres}) - (\text{Total des souscriptions} + \text{Total des rachats})) / \text{l'actif net moyen du Fonds}$.

Le Turnover ratio au 30 juin 2024 est de +37,81%.