

AMUNDI ABS

OPCVM de droit français

INFORMATIONS SEMESTRIELLES - NOVEMBRE 2024

Société de Gestion
Amundi Asset Management

Sous déléataire de gestion comptable en titre
Caceis Fund Administration

Dépositaire
CACEIS BANK

Commissaire aux Comptes
PRICEWATERHOUSECOOPERS AUDIT

Etat du patrimoine en EUR

Eléments 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	1 011 100 124,05
b) Avoirs bancaires	1 787 086,86
c) Autres actifs détenus par l'OPC	65 430 790,32
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	1 078 318 001,23
e) Passif	-9 891 754,60
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	1 068 426 246,63

(*) Les montants sont signés

Nombre de parts en circulation et valeur nette d'inventaire par part

Part	Type de part	Actif net de la part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
AMUNDI ABS D en EUR	D	800 235,73	4,001	200 008,93
AMUNDI ABS I3-C en EUR	C	163 346 934,55	1 429,479	114 270,25
AMUNDI ABS I-C en EUR	C	837 335 123,37	3 024,61181	276 840,52
AMUNDI ABS I-GBP en GBP	D	204 551,46	1,000	204 551,46
AMUNDI ABS L en EUR	C	4 806 951,05	43 021,061	111,73
AMUNDI ABS M-D en EUR	D	59 367 080,15	569,047	104 327,19
AMUNDI ABS R-C en EUR	C	2 523 755,99	22 322,526	113,05

Eléments du portefeuille titres

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
A) Les titres financiers éligibles et les 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.	86,92	86,13
Et B) Les titres financiers éligibles et les 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.		
C) Les titres financiers éligibles et les 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.	7,71	7,64
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	5,88	5,83

(*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(**) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

Répartition des actifs du A), B), C), D) du portefeuille titres, par devise

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
Euro	EUR	941 693 002,78	88,14	87,33
Livre Sterling	GBP	60 269 649,93	5,64	5,59
Couronne Danoise	DKK	9 137 471,34	0,86	0,85
TOTAL		1 011 100 124,05	94,63	93,77

(*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(**) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

Répartition des actifs du A), B), C), D) du portefeuille titres, par pays de résidence de l'émetteur

Pays	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
IRLANDE	40,12	39,75
PAYS-BAS	12,27	12,16
ITALIE	10,67	10,57
ESPAGNE	10,62	10,52
ROYAUME-UNI	7,71	7,64
LUXEMBOURG	6,05	5,99
FRANCE	2,98	2,96
ALLEMAGNE	2,54	2,52
DANEMARK	0,86	0,85
PORTUGAL	0,81	0,81
TOTAL	94,63	93,77

(*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(**) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

Répartition des autres actifs du E) du portefeuille titres, par nature

Nature d'actifs	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	4,03	4,00
Autres OPC et fonds d'investissements	1,85	1,83
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne		
Autres		
TOTAL	5,88	5,83

(*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(**) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

Mouvements dans le portefeuille titres en cours de période en EUR

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
A) Les titres financiers éligibles et les 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.	219 992 228,29	264 659 029,84
Et B) Les titres financiers éligibles et les 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.		
C) Les titres financiers éligibles et les 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.	36 017 932,66	45 748 725,34
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	299 758 262,22	325 641 160,75

Distribution en cours de période

	Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
Dividendes versés				
14/06/2024	AMUNDI ABS D	4 450,68	0,264	4 450,94
16/09/2024	AMUNDI ABS I-GBP	2 740,18		2 740,18
14/06/2024	AMUNDI ABS M-D	2 504,10	0,138	2 504,24
Dividendes à verser				
	AMUNDI ABS D			
	AMUNDI ABS I-GBP			
	AMUNDI ABS M-D			

Transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation des instruments financiers - Règlement SFTR - en devise de comptabilité de l'OPC (EUR)

Au cours de l'exercice, l'OPC n'a pas fait l'objet d'opérations relevant de la réglementation SFTR.

Inventaire des actifs et passifs

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES			1 011 100 124,05	94,64
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			1 011 100 124,05	94,64
Banques commerciales			5 650 831,79	0,53
IM PASTOR 2 E3R+0.85% 22-09-41	EUR	2 900 000	2 906 759,56	0,27
IM PASTOR 2 E3R+2.8% 22-09-41	EUR	1 500 000	1 507 220,03	0,14
MBS BANCAJA 4 FONDO DE TITULIZAC DE ACT E3R+0.22% 23-07-50	EUR	3 000 000	1 236 852,20	0,12
Composants automobiles			13 224 344,32	1,24
BUMPER NL 2024 1 BV E1R+0.64% 21-03-36	EUR	13 200 000	13 224 344,32	1,24
Crédit à la consommation			18 139 435,61	1,70
AUTONORIA SPAIN 2021 FT E1R+1.55% 31-01-39	EUR	5 000 000	1 778 571,72	0,17
AUTONORIA SPAIN 2021 FT E1R+2.65% 31-01-39	EUR	1 100 000	390 044,92	0,04
AUTONORIA SPAIN 2021 FT E1R+3.9% 31-01-39	EUR	2 400 000	850 570,82	0,08
BNPP AM EURO CLO 2018 BV E3R+1.25% 15-04-31	EUR	2 500 000	2 489 328,63	0,23
DILOSK RMBS 3 E3R+0.75% 24-09-60	EUR	2 000 000	2 015 546,04	0,19
DILOSK RMBS 3 E3R+2.8% 20-10-62	EUR	591 000	598 391,33	0,06
DILOSK RMBS 3 E3R+4.4% 20-10-62	EUR	1 279 000	1 319 412,92	0,12
FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 20211 E3R+1.15% 22-06-35	EUR	3 000 000	1 822 683,81	0,17
FT SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 20201 3.5% 21-03-33	EUR	8 900 000	1 829 891,42	0,17
RRE LOAN MANAGEMENT E3R+2.1% 15-04-39	EUR	5 000 000	5 044 994,00	0,47
Distribution spécialisée			30 291 277,06	2,84
RED BLACK AUTO ITALY SRL E1R+1.0% 28-07-34	EUR	10 100 000	6 440 531,75	0,60
RED BLACK AUTO ITALY SRL E1R+1.0% 28-12-31	EUR	3 900 000	1 430 068,23	0,13
RED BLACK AUTO ITALY SRL E1R+1.1% 28-07-36	EUR	2 700 000	2 699 505,21	0,25
RED BLACK AUTO ITALY SRL E1R+1.5% 28-07-36	EUR	2 100 000	2 103 745,89	0,20
RED BLACK AUTO ITALY SRL E1R+2.15% 28-07-36	EUR	1 600 000	1 607 891,22	0,15
RED BLACK AUTO ITALY SRL E1R+2.8% 28-07-34	EUR	2 000 000	2 031 138,13	0,19
RED BLACK AUTO ITALY SRL E1R+2.85% 28-12-31	EUR	1 800 000	663 922,59	0,06
RED BLACK AUTO ITALY SRL E1R+3.8% 28-07-34	EUR	3 100 000	3 180 246,43	0,30
RED BLACK AUTO ITALY SRL E1R 28-07-36	EUR	9 000 000	8 727 855,88	0,82
RED N BLACK AUTO GERMANY 11 UG E1R+1.15% 15-09-33	EUR	700 000	702 057,50	0,07
RED N BLACK AUTO GERMANY 11 UG E1R+1.6% 15-09-33	EUR	700 000	704 314,23	0,07
Epargne et prêts hypothécaires			98 357 803,99	9,21
ADAGIO V CLO DAC E3R+2.2% 15-10-31	EUR	3 600 000	3 631 268,16	0,34
AQUEDUCT EUROPEAN CLO 32019 DAC E3R+0.93% 15-08-34	EUR	8 594 000	8 603 216,01	0,81
AQUEDUCT EUROPEAN CLO 32019 DAC E3R+2.0% 15-08-34	EUR	1 000 000	1 005 399,59	0,09
ARBOUR CLO IV DAC E3R+0.79% 15-04-34	EUR	4 000 000	3 999 063,20	0,37
ARBOUR CLO IV DAC E3R+2.05% 15-04-34	EUR	1 000 000	1 011 166,00	0,09

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
AURIUM CLO IV DAC E3R+2.3% 16-01-31	EUR	2 000 000	1 991 363,11	0,19
AUTOFLORENCE 3 SRL E1R+3.35% 25-12-46	EUR	3 000 000	2 554 214,07	0,24
AUTONORIA SPAIN 2019 E1R+1.85% 27-12-35	EUR	5 000 000	630 408,56	0,06
AUTONORIA SPAIN 2019 E1R+2.85% 27-12-35	EUR	4 900 000	617 526,57	0,06
AUTONORIA SPAIN 2019 E1R+4.0% 27-12-35	EUR	10 000 000	1 262 976,88	0,12
AVOCA CLO XXIV DAC E3R+0.9% 15-07-34	EUR	6 000 000	6 025 464,90	0,56
AVOCA CLO XXIV DAC E3R+2.0% 15-07-34	EUR	3 000 000	3 034 708,05	0,28
BAIN CAPITAL EURO CLO 20231 DAC E3R+3.6% 25-10-37	EUR	3 000 000	3 041 802,53	0,28
BLUEMOUNTAIN FUJI EUR CLO III DAC E3R+1.55% 15-01-31	EUR	500 000	503 465,30	0,05
BLUEMOUNTAIN FUJI EUR CLO III DAC E3R+2.1% 15-01-31	EUR	3 500 000	3 538 047,10	0,33
BRUEGEL 2021 1X A E3R+0.8% 22-05-31	EUR	8 700 000	7 641 037,04	0,72
BRUEGEL 2021 1X A E3R+1.25% 22-05-31	EUR	2 000 000	1 714 205,78	0,16
CAPITAL FOUR CLO I DAC E3R+3.15% 25-10-36	EUR	3 000 000	3 051 982,13	0,29
CAPITAL FOUR CLO I DAC E3R+4.0% 15-01-33	EUR	7 899 000	7 983 788,66	0,75
CAPITAL FOUR CLO I DAC E3R+4.9% 25-10-36	EUR	1 000 000	1 028 635,07	0,10
CONTEGO CLO IV DESIGNATED ACTI E3R+1.9% 23-01-30	EUR	4 500 000	4 530 619,10	0,42
CONTEGO CLO IV DESIGNATED ACTI E3R+1.9% 23-01-30	EUR	720 000	724 899,06	0,07
GREEN STORM 2023 BV E3R+0.38% 22-02-70	EUR	7 000 000	6 993 418,06	0,65
LUSITANO MORTGAGES NO 5 E3R+0.5% 15-07-59	EUR	2 400 000	1 247 055,40	0,12
MAGELLAN MORTGAGE TV 15/05/58	EUR	100 000 000	9 895 446,44	0,94
NORDEA KREDIT REALKREDIT 0.5% 01-10-40	DKK	4 253 754,07	486 486,07	0,05
NORDEA KREDIT REALKREDIT 0.5% 01-10-43	DKK	6 460 778,22	730 345,41	0,07
NORDEA KREDIT REALKREDIT 0.5% 01-10-50	DKK	0,2	0,02	0,00
NORDEA KREDIT REALKREDIT 1.0% 01-10-50	DKK	4 493 063,74	498 332,54	0,05
NORDEA KREDIT REALKREDIT 1.0% 01-10-53	DKK	7 100 786,92	781 107,29	0,07
NORDEA KREDIT REALKREDIT 1.5% 01-10-37	DKK	963 864,16	121 893,08	0,01
NORDEA KREDIT REALKREDIT 1.5% 01-10-40	DKK	1 008 879,32	125 314,93	0,01
NORDEA KREDIT REALKREDIT 1.5% 01-10-50	DKK	1 251 523,46	143 834,08	0,01
NORDEA KREDIT REALKREDIT 1.5% 01-10-50	DKK	2 187 764,72	244 578,01	0,02
NORDEA KREDIT REALKREDIT 2.0% 01-07-50	DKK	1 993 730,61	237 672,90	0,02
NORDEA KREDIT REALKREDIT 2.0% 01-10-50	DKK	1 289 238,33	156 556,76	0,01
RED BLACK AUTO GERMANY 8 UG E1R+1.35% 15-09-30	EUR	800 000	311 071,24	0,03
RURAL HIPOTECARIO I FTH E3R+0.32% 17-02-50	EUR	2 000 000	428 200,67	0,04
TIKEHAU CLO II DAC E3R+3.4% 07-09-35	EUR	4 700 000	4 802 159,67	0,45
VENDOME FUNDING CLO 20201 DAC E3R+2.0% 20-07-34	EUR	3 000 000	3 029 074,55	0,28
Equipements et instruments électroniques			3 023 042,00	0,28
GREEN STORM 2022 BV E3R+0.75% 22-05-69	EUR	3 000 000	3 023 042,00	0,28
Gestion et promotion immobilière			10 053 256,91	0,94
ARES LUSITANISTC SAPELICAN FINANCE 2 E1R+2.25% 25-01-35	EUR	5 100 000	1 704 839,84	0,16
ARES LUSITANISTC SAPELICAN FINANCE 2 E1R+4.25% 25-01-35	EUR	3 500 000	1 178 115,09	0,11
BNPP IP EURO CLO 20151 DAC E3R+0.79% 15-10-30	EUR	4 038 000	2 399 051,00	0,22
PROVIDUS CLO IV DAC E3R+2.2% 20-04-34	EUR	4 650 000	4 729 168,96	0,45
SC GERMANY SA COMPART CONSUMER 20201 E1R+2.5% 14-11-34	EUR	200 000	42 082,02	0,00

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Marches de capitaux			142 765 160,93	13,36
AQUEDUCT EUROPEAN CLO 8 DAC E3R+3.7% 15-07-37	EUR	3 250 000	3 399 541,93	0,32
AURIUM CLO V DAC E3R+3.5% 17-04-34	EUR	5 000 000	5 104 965,47	0,48
AURIUM CLO XI DAC E3R+1.7% 18-01-38	EUR	2 000 000	2 016 750,40	0,19
AURIUM CLO XI DAC E3R+3.0% 18-01-38	EUR	3 000 000	3 039 716,60	0,28
AURIUM CLO XI DAC E3R+4.75% 18-01-38	EUR	1 960 000	2 005 858,58	0,19
AURORUS 2023 BV E1R+3.2% 13-08-49	EUR	3 000 000	2 879 555,53	0,27
AUTO ABS ITALIAN STELLA LOANS 20241 SRL E1R+1.7% 29-12-36	EUR	3 390 000	3 406 846,27	0,32
AUTO ABS ITALIAN STELLA LOANS 20241 SRL E1R+2.3% 29-12-36	EUR	3 700 000	3 701 973,21	0,35
BBVA CONSUMO FTA E3R+5.4% 21-04-37	EUR	2 400 000	2 184 522,73	0,20
BLACKROCK EUROPEAN CLO IV DAC E3R+0.85% 15-07-30	EUR	2 500 000	979 419,77	0,09
BLACKROCK EUROPEAN CLO IV DAC E3R+2.65% 15-07-30	EUR	900 000	910 955,19	0,09
BPCE HOME LOANS FCT 2023 E3R+0.7% 31-10-57	EUR	17 000 000	15 614 159,72	1,43
CANDIDE FINANCING 20241 BV E3R+0.5% 20-11-60	EUR	4 000 000	4 026 644,53	0,38
CONTEGO CLO VIII DAC E3R+3.2% 25-01-34	EUR	2 750 000	2 793 523,67	0,26
FONDO RURAL HIPOTECARIO IX E3R+0.52% 17-02-50	EUR	9 800 000	2 009 571,22	0,19
FONDO TDA CAM 5 CL.B E3R 26/10/43	EUR	4 000 000	3 744 607,91	0,35
FTA SANTANDER CONSUMO 4 2.2% 18-09-32	EUR	2 700 000	689 721,11	0,06
FTA SANTANDER CONSUMO 4 3.7% 18-09-32	EUR	12 800 000	3 291 694,13	0,31
FTA SANTANDER CONSUMO 4 4.9% 18-09-32	EUR	4 200 000	1 080 235,71	0,10
FTDA CONSUMO SANTANDER 2 E3R+0.72% 21-12-37	EUR	2 600 000	2 619 785,06	0,25
FTDA CONSUMO SANTANDER 2 E3R+1.45% 21-12-37	EUR	1 500 000	1 520 771,18	0,14
FTDA CONSUMO SANTANDER 2 E3R+5.5% 21-12-37	EUR	3 000 000	3 126 479,85	0,29
FTDA CONSUMO SANTANDER 2 E3R 20-07-38	EUR	3 200 000	3 202 861,01	0,30
FTDA CONSUMO SANTANDER 2 E3R 20-07-38	EUR	4 600 000	4 613 638,54	0,43
GOLDEN BAR SECURITISATIONSRL E3R+2.15% 22-09-43	EUR	7 000 000	7 093 356,90	0,66
GOLDEN BAR SECURITISATIONSRL E3R+3.4% 22-09-43	EUR	1 000 000	1 014 870,17	0,09
KOROMO UK 1 SONIO+0.6% 23-10-34	GBP	9 200 000	11 079 241,27	1,04
MAGOI 2019 BV E1R+2.5% 27-07-39	EUR	2 400 000	375 525,26	0,04
MAGOI 2019 BV E1R+3.7% 27-07-39	EUR	7 500 000	1 167 516,97	0,11
NORTH WESTERLY VI BV E3R+0.97% 05-07-32	EUR	4 000 000	3 854 073,12	0,36
NORTH WESTERLY VI BV E3R+1.75% 05-07-32	EUR	700 000	706 411,44	0,07
NORTH WESTERLY VI BV E3R+2.85% 05-07-32	EUR	1 000 000	1 010 482,90	0,09
PENTA CLO 17 DAC E3R+1.36% 15-08-38	EUR	2 000 000	2 037 647,93	0,19
PENTA CLO 17 DAC E3R+2.25% 15-08-38	EUR	2 750 000	2 843 151,18	0,27
PENTA CLO 17 DAC E3R+3.25% 15-08-38	EUR	1 600 000	1 660 544,59	0,16
PENTA CLO 6 DAC E3R+2.3% 25-07-34	EUR	1 000 000	1 017 045,39	0,10
PIETRA NERA SRL E3R+1.75% 22-05-30	EUR	4 700 000	2 112 551,77	0,20
PIETRA NERA SRL E3R+2.15% 22-05-30	EUR	5 050 000	2 416 970,79	0,23
PONY SA COMPART GERMAN AUTO LOANS 20241 E1R+1.65% 14-01-33	EUR	1 500 000	1 494 607,60	0,14
PURPLE FINANCE CLO 2 DAC E3R+1.0% 20-04-32	EUR	11 500 000	7 977 596,74	0,75
PURPLE FINANCE CLO 2 DAC E3R+2.35% 20-04-32	EUR	2 000 000	2 022 717,57	0,19
RURAL HIPOTECARIO IV FONDO DE TITULIZAC E3R+0.55% 19-01-44	EUR	7 200 000	1 342 530,09	0,13

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SC GERMANY SA COMPARTMENT CONSUM 2023 1 E1R+2.7% 15-09-37	EUR	7 200 000	6 642 604,86	0,62
SC GERMANY SA COMPARTMENT CONSUM 2023 1 E1R+4.15% 15-09-37	EUR	4 200 000	3 926 321,95	0,37
SC GERMANY SA COMPARTMENT CONSUMR 2024 2 E1R+1.4% 14-05-38	EUR	900 000	900 682,34	0,08
SUNRISE SPV Z70 SRL E1R+0.84% 27-10-49	EUR	2 100 000	2 104 910,78	0,20
Services aux entreprises			84 967 260,37	7,95
ADAGIO XII EUR CLO DAC E3R+1.32% 20-10-37	EUR	3 000 000	3 049 161,03	0,29
ADAGIO XII EUR CLO DAC E3R+2.45% 20-10-37	EUR	5 000 000	5 103 898,06	0,48
ADAGIO XII EUR CLO DAC E3R+3.75% 20-10-37	EUR	5 000 000	5 149 460,17	0,48
AUTO ABS SPANISH LOANS 20241 FT E1R+2.9% 28-09-38	EUR	3 600 000	3 639 018,00	0,34
AUTO ABS SPANISH LOANS 20241 FT E1R+4.0% 28-09-38	EUR	1 300 000	1 316 635,67	0,12
BLACKROCK EUROPEAN CLO X DESIGNATED E3R+1.78% 15-10-34	EUR	505 000	510 546,36	0,05
BRIGNOLE E1R 24-02-42	EUR	2 750 000	2 321 267,46	0,22
BRIGNOLE E1R 24-02-42	EUR	1 600 000	1 371 308,10	0,13
CITIZEN IRISH AUTO RECEIVABLES TRUST E1R+2.4% 15-12-32	EUR	1 100 000	1 114 615,52	0,10
FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 20231 E3R+1.7% 22-09-39	EUR	1 100 000	1 119 088,33	0,10
FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 20231 E3R+2.7% 22-09-39	EUR	3 700 000	3 801 786,03	0,36
FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 20231 E3R+5.1% 22-09-39	EUR	3 500 000	3 848 707,12	0,36
HILL FL 20231 BV E1R+1.6% 18-05-31	EUR	1 100 000	854 874,29	0,08
HILL FL 20231 BV E1R+4.4% 18-05-31	EUR	6 000 000	4 746 333,16	0,44
HILL FL 20241 BV E1R+1.1% 18-02-32	EUR	900 000	901 523,02	0,08
HILL FL 20241 BV E1R+2.05% 18-02-32	EUR	400 000	404 817,37	0,04
HILL FL 20241 BV E1R+3.2% 18-02-32	EUR	700 000	710 006,36	0,07
ITALIAN STELLA LOANS SRL E1R+2.15% 27-05-39	EUR	1 500 000	1 500 839,58	0,14
MILTONIA MORTGAGE FINANCE SRL E3R+1.3% 28-04-62	EUR	10 000 000	9 914 582,78	0,92
PCL FUNDING IX SONIO+2.15% 16-07-29	GBP	855 000	1 032 921,19	0,10
PENTA CLO 3 DESIGNATED ACTIVIT E3R+0.96% 17-04-35	EUR	4 350 000	4 374 168,19	0,41
PENTA CLO 3 DESIGNATED ACTIVIT E3R+2.45% 17-04-35	EUR	5 800 000	5 849 630,18	0,55
SOUND POINT EURO CLO X FUNDING DAC E3R+2.65% 20-04-38	EUR	2 350 000	2 386 201,48	0,22
SOUND POINT EURO CLO X FUNDING DAC E3R+4.0% 20-04-38	EUR	5 500 000	5 630 144,76	0,53
TAURUS CMBSGERMANY20061 E3R+1.0% 18-05-30	EUR	10 000 000	1 590 522,89	0,15
TIKEHAU CLO X DAC E3R+2.3% 20-04-38	EUR	3 500 000	3 546 563,88	0,33
TIKEHAU CLO X DAC E3R+4.0% 20-04-38	EUR	5 000 000	5 125 999,92	0,48
WILTON PARK CLO DESIGNATED ACTIVITY COMP E3R+5.2% 25-11-36	EUR	4 000 000	4 052 639,47	0,38
Services clientèle divers			5 815 193,15	0,54
QUARZO SRL E3R+2.3% 15-06-41	EUR	3 300 000	3 363 031,76	0,31
QUARZO SRL E3R+3.7% 15-06-41	EUR	2 400 000	2 452 161,39	0,23
Services financiers diversifiés			330 765 387,91	30,97
ADAGIO CLO E3R+0.82% 15-04-34	EUR	5 000 000	5 011 561,50	0,47
ALBA 14 SPV SRL E3R+0.82% 27-01-44	EUR	3 700 000	3 326 738,67	0,31
ALBACORE EURO CLO I DAC E3R+1.75% 18-10-34	EUR	5 000 000	5 037 485,17	0,47
ALBACORE EURO CLO I DAC E3R+2.2% 18-10-34	EUR	4 375 000	4 426 104,96	0,41

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ALBACORE EURO CLO II DAC E3R+2.5% 15-06-34	EUR	3 000 000	3 060 150,23	0,29
ARBOUR CLO E3R+0.86% 15-04-34	EUR	6 750 000	6 751 424,93	0,63
ARBOUR CLO E3R+1.5% 15-04-34	EUR	3 100 000	3 117 007,84	0,29
ARBOUR CLO XII DAC E3R+3.0% 15-01-38	EUR	5 000 000	5 085 125,00	0,48
ARBOUR CLO XII DAC E3R+5.0% 15-01-38	EUR	5 000 000	5 128 093,50	0,48
ASIMI FUNDING 20241 SONIO+1.35% 16-09-31	GBP	1 000 000	1 207 904,42	0,11
ASIMI FUNDING 20241 SONIO+1.95% 16-09-31	GBP	1 000 000	1 208 979,02	0,11
ASTI GROUP RMBS III SRL E3R+0.7% 29-12-82	EUR	5 500 000	3 536 906,42	0,33
ATLAS FUNDING 20241 SONI1R+1.55% 20-09-61	GBP	800 000	962 325,48	0,09
ATLAS FUNDING 20241 SONIO+1.3% 20-09-61	GBP	900 000	1 086 542,81	0,10
AUTO1 CAR FUNDING SARL E1R+1.0% 15-12-33	EUR	1 200 000	1 199 992,87	0,11
AUTONORIA SPAIN 2022 E1R+4.2% 28-01-40	EUR	1 100 000	660 217,63	0,06
AVOCA CLO XXIX DAC E3R+2.5% 15-04-37	EUR	3 500 000	3 539 615,28	0,33
AVOCA CLO XXIX DAC E3R+3.9% 15-04-37	EUR	3 000 000	3 049 782,45	0,29
AVOCA CLO XXX DAC E3R+2.15% 15-07-37	EUR	3 900 000	3 933 190,76	0,37
AVOCA CLO XXX DAC E3R+3.95% 15-07-37	EUR	3 500 000	3 555 593,48	0,33
BBVA CONSUMER AUTO 20241 FT E3R+1.6% 19-03-38	EUR	2 700 000	2 736 981,87	0,26
BILBAO CLO IV DAC E3R+2.2% 15-04-36	EUR	3 000 000	3 053 285,40	0,29
BLACKROCK EUROPEAN CLO III DAC E3R+2.0% 19-07-35	EUR	1 500 000	1 518 964,23	0,14
BPCE HOME LOANS FCT E3R+0.6% 31-10-58	EUR	3 200 000	3 217 564,82	0,30
BRACCAN MORTGAGE FUNDING 2024 1 SONIO+1.2% 15-01-67	GBP	3 900 000	4 765 947,90	0,45
BRIGNOLE CQ E1R+1.25% 24-09-40	EUR	5 300 000	5 054 668,62	0,47
BRIGNOLE CQ E1R+1.85% 24-09-40	EUR	4 200 000	3 988 158,20	0,37
CARS ALLIANCE AUTO LEASES FRA V 20231 E1R+0.65% 21-10-38	EUR	4 500 000	4 273 190,32	0,40
CARS ALLIANCE AUTO LEASES FRA V 20231 E1R+1.3% 21-10-38	EUR	4 800 000	4 818 676,48	0,45
CROSS OCEAN BOSPHERUS CLO IX D AC E3R+3.47% 15-04-38	EUR	1 000 000	1 027 834,25	0,10
DILOSK RMBS NO 5 DAC E3R+1.6% 20-12-60	EUR	777 000	784 167,98	0,07
DILOSK RMBS NO 9 DAC E3R+0.68% 25-01-63	EUR	900 000	859 571,61	0,08
DILOSK RMBS NO 9 DAC E3R+1.0% 25-01-63	EUR	1 700 000	1 700 958,12	0,16
DILOSK RMBS NO 9 DAC E3R+1.4% 25-01-63	EUR	1 000 000	994 239,79	0,09
DRYDEN 103 EURO CLO 2021 DAC E3R+4.0% 19-01-38	EUR	600 000	600 000,00	0,06
ECARAT DE SA 20241 E1R+1.75% 25-11-35	EUR	1 200 000	1 196 061,07	0,11
ECARAT DE SA 20241 E1R+3.65% 25-11-35	EUR	800 000	808 807,25	0,08
FINANCE IRELAND AUTO RECEIVABLES NO 1 E1R+0.85% 12-09-33	EUR	13 100 000	8 319 331,49	0,78
FINANCE IRELAND AUTO RECEIVABLES NO 1 E1R+1.3% 12-09-33	EUR	3 000 000	3 011 929,32	0,28
FINANCE IRELAND AUTO RECEIVABLES NO 1 E1R+2.3% 12-09-33	EUR	2 000 000	2 025 710,92	0,19
FTA SANTANDER CONSUMO 5 E3R+0.85% 21-03-36	EUR	3 600 000	2 306 938,19	0,22
GOLDEN BAR SECURITISATION SRL 20211 2.75% 22-09-41	EUR	3 700 000	1 620 978,32	0,15
GOLDEN BAR SECURITISATION SRL 2023 2 E3R+2.9% 22-09-43	EUR	2 600 000	2 699 294,42	0,25
GOLDEN BAR SECURITISATION SRL 2023 2 E3R+3.6% 22-09-43	EUR	1 300 000	1 347 399,22	0,13
GOLDEN BAR SECURITISATION SRL 2023 2 E3R+5.7% 22-09-43	EUR	1 000 000	1 061 044,17	0,10
GRIFONAS FINANCE NO1 E6R+0.28% 28-08-39	EUR	60 800 000	8 329 727,11	0,78
HARVEST CLO XXVIII DA E3R+2.65% 25-10-34	EUR	600 000	608 956,54	0,06
HENLEY CLO VI DAC E3R+2.15% 10-06-34	EUR	1 750 000	1 767 038,27	0,17

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
HENLEY CLO VII DAC E3R+2.1% 25-04-34	EUR	3 000 000	3 033 383,53	0,28
HENLEY CLO VII DAC E3R+3.0% 25-04-34	EUR	10 000 000	10 129 154,44	0,95
HERMITAGE 2024 SONIO+1.6% 21-04-33	GBP	1 000 000	1 035 038,15	0,10
HERMITAGE 2024 SONIO+2.35% 21-04-33	GBP	500 000	519 801,60	0,05
HILL FL 20221 B E1R+1.9% 18-05-30	EUR	2 000 000	841 801,19	0,08
HILL FL 20242 BV E1R+1.4% 18-10-32	EUR	1 200 000	1 194 286,81	0,11
HOPS HILL NO 4 SONIO+0.88% 21-04-56	GBP	7 000 000	8 449 286,65	0,79
HOPS HILL NO 4 SONIO+1.3% 21-04-56	GBP	1 400 000	1 685 721,36	0,16
JUBILEE CLO 2018XXI BV E3R+1.4% 15-04-35	EUR	5 000 000	5 019 489,50	0,47
JUBILEE CLO 2018XXI BV E3R+2.2% 15-04-35	EUR	4 000 000	4 056 864,80	0,38
KOROMO ITALY SRL E1R+0.8% 26-02-35	EUR	10 073 000	5 168 265,63	0,48
MAGEL 4 B E3R 20/07/59	EUR	15 000 000	2 241 126,58	0,21
MAGELLAN MORTGAGES 4 E3R+0.28% 20-07-59	EUR	101 010 000	11 901 248,80	1,16
MILA 20241 BV E1R+2.0% 16-09-41	EUR	1 300 000	1 302 998,12	0,12
MILA 20241 BV E1R+4.1% 16-09-41	EUR	1 000 000	1 004 731,71	0,09
MILA 20241 BV E1R+5.4% 16-09-41	EUR	1 250 000	1 255 492,49	0,12
MONTMARTRE EURO CLO 20202 DAC E3R+2.1% 15-07-34	EUR	2 277 000	2 292 852,70	0,21
NASSAU EURO CLO IV DAC E3R+2.6% 20-07-38	EUR	4 800 000	4 947 492,05	0,46
NASSAU EURO CLO IV DAC E3R+3.95% 20-07-38	EUR	3 400 000	3 545 756,34	0,33
NORIA DE 2024 E1R+1.25% 25-02-43	EUR	800 000	797 003,84	0,07
NORIA DE 2024 E1R+1.65% 25-02-43	EUR	1 400 000	1 386 859,38	0,13
NORIA DE 2024 E1R+3.55% 25-02-43	EUR	1 000 000	1 007 690,26	0,09
NORTH WESTERLY CLO V BV E3R+3.2% 20-07-34	EUR	3 300 000	3 359 896,38	0,31
NORTH WESTERLY VII ESG CLO DAC E3R+0.84% 15-05-34	EUR	8 100 000	8 086 919,94	0,76
NORTH WESTERLY VII ESG CLO DAC E3R+1.5% 15-05-34	EUR	700 000	699 536,00	0,07
NORTH WESTERLY VII ESG CLO DAC E3R+2.0% 15-05-34	EUR	2 700 000	2 714 143,38	0,25
NORTH WESTERLY VII ESG CLO DAC E3R+2.95% 15-05-34	EUR	4 650 000	4 657 838,66	0,44
PBD GERMANY AUTO LEASE MASTER SA 20211 E1R+2.1% 26-11-30	EUR	4 200 000	796 405,98	0,07
PBD GERMANY AUTO LEASE MASTER SA 20211 E1R+3.5% 26-11-30	EUR	1 500 000	284 933,27	0,03
PENTA CLO 11 DAC E3R+3.3% 15-07-37	EUR	3 150 000	3 236 745,80	0,30
PENTA CLO 12 DAC E3R+2.7% 09-05-37	EUR	1 900 000	1 924 035,76	0,18
PENTA CLO 12 DAC E3R+3.9% 09-05-37	EUR	2 300 000	2 344 710,62	0,22
PENTA CLO 15 DAC E3R+3.3% 15-01-37	EUR	2 000 000	2 037 749,10	0,19
PONY SA COMPART GERMAN AUTO LOANS 20231 E1R+3.1% 14-11-32	EUR	700 000	715 462,58	0,07
PONY SA COMPART GERMAN AUTO LOANS 20231 E1R+5.4% 14-11-32	EUR	1 200 000	1 250 671,52	0,12
PROVIDUS CLO I DAC E3R+1.6% 14-05-31	EUR	3 135 000	3 143 197,82	0,29
PROVIDUS CLO VII DAC E3R+2.3% 15-07-38	EUR	1 800 000	1 831 383,36	0,17
PROVIDUS CLO VII DAC E3R+3.25% 15-07-38	EUR	1 500 000	1 531 419,60	0,14
RED BLACK AUTO GERMANY 10 UG E1R+2.1% 15-09-32	EUR	1 200 000	1 216 240,00	0,11
RED BLACK AUTO GERMANY 10 UG E1R+3.1% 15-09-32	EUR	3 000 000	3 065 477,17	0,29
RED BLACK AUTO GERMANY 7 UG E1R+2.7% 15-10-29	EUR	2 500 000	423 152,93	0,04
REVOCAR 20241 UG E1R+1.3% 21-02-37	EUR	900 000	785 080,06	0,07
REVOCAR 20241 UG E1R+2.3% 21-02-37	EUR	1 700 000	1 495 359,25	0,14

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
REVOCAR 20241 UG E1R+4.1% 21-02-37	EUR	1 300 000	1 152 120,17	0,11
REVOCAR 20242 UG E1R+1.6% 25-07-37	EUR	1 000 000	967 515,07	0,09
REVOCAR 20242 UG E1R+3.0% 25-07-37	EUR	1 000 000	965 838,72	0,09
SCF RAHOITUSPALVELUT X DAC E1R+0.95% 25-10-31	EUR	1 300 000	570 612,95	0,05
SCF RAHOITUSPALVELUT X DAC E1R+1.25% 25-10-31	EUR	2 200 000	966 291,73	0,09
SCF RAHOITUSPALVELUT XIII DAC E1R+1.0% 25-06-34	EUR	1 100 000	1 093 970,59	0,10
SCF RAHOITUSPALVELUT XIII DAC E1R+1.4% 25-06-34	EUR	600 000	600 842,92	0,06
SC GERMANY SA COMPARTMENT CONSUMER 2021 E1R+0.95% 14-11-35	EUR	9 700 000	6 550 965,59	0,61
SC GERMANY SA COMPARTMENT CONSUMER 2021 E1R+1.85% 14-11-35	EUR	15 100 000	10 183 085,28	0,95
SC GERMANY SA COMPARTMENT CONSUMER 2021 E1R+2.8% 14-11-35	EUR	2 400 000	1 608 538,62	0,15
TIKEHAU CLO II BV E3R+2.4% 15-01-35	EUR	6 300 000	6 409 327,05	0,60
TIKEHAU CLO IV BV E3R+2.15% 15-10-31	EUR	3 000 000	3 043 746,90	0,28
TIKEHAU CLO IV BV E3R+3.3% 15-10-31	EUR	3 500 000	3 556 951,30	0,33
TIKEHAU CLO IX DAC E3R+3.55% 20-01-37	EUR	2 400 000	2 400 473,33	0,22
TIKEHAU CLO V DAC E3R+3.9% 15-04-32	EUR	4 761 000	4 848 903,30	0,45
TIKEHAU CLO VI DESIGNATED ACTI E3R+1.78% 15-01-35	EUR	3 000 000	3 036 616,80	0,28
TIKEHAU CLO XII DAC E3R+1.34% 20-10-38	EUR	2 000 000	2 044 646,24	0,19
TOWER BRIDGE FUNDING 20221 SONIO+1.7% 20-12-63	GBP	500 000	600 347,01	0,06
TOWER BRIDGE FUNDING 20232 SONIO+2.2% 20-03-65	GBP	700 000	845 841,60	0,08
TOWER BRIDGE FUNDING 20232 SONIO+3.2% 20-03-65	GBP	800 000	983 617,44	0,09
TOWER BRIDGE FUNDING 20242 SONIO+1.2% 20-05-66	GBP	3 850 000	4 649 909,47	0,44
TOWER BRIDGE FUNDING 20243 SONIO+1.4% 20-12-66	GBP	1 840 000	2 215 609,77	0,21
TOWER BRIDGE FUNDING 20243 SONIO+1.9% 20-12-66	GBP	1 950 000	2 345 887,67	0,22
VOYA EURO CLO IV DAC E3R+3.1% 15-10-34	EUR	3 000 000	3 050 946,90	0,29
VOYA EURO CLO VIII DAC E3R+1.28% 15-01-39	EUR	5 000 000	5 000 000,00	0,47
YOUNI ITALY 20241 SRL E1R+2.7% 20-04-34	EUR	2 450 000	2 021 236,75	0,19
YOUNI ITALY 20241 SRL E1R+5.0% 20-04-34	EUR	1 500 000	1 252 671,33	0,12
SIIC spécialisées dans le crédit hypothécaire			188 403 129,11	17,63
ARES EUROPEAN CLO XVII DAC E3R+1.7% 15-07-37	EUR	3 000 000	3 040 173,30	0,28
AUTO ABS ITALIAN STELLA LOANS 20231 SRL E1R+4.9% 26-10-39	EUR	1 150 000	1 196 287,25	0,11
AUTO ABS SPANISH LOANS 20201 3.6% 28-12-35	EUR	19 500 000	2 538 434,01	0,24
AUTOFLORENCE 2 SRL E1R+1.15% 24-12-44	EUR	4 668 000	1 606 805,57	0,15
AUTOFLORENCE 2 SRL E1R+2.35% 24-12-44	EUR	1 100 000	381 561,26	0,04
AUTOFLORENCE 2 SRL E1R+3.35% 24-12-44	EUR	1 500 000	522 258,17	0,05
AUTONORIA SPAIN 2023 FONDO DE TITULIZA E1R+2.9% 30-09-41	EUR	1 100 000	931 632,02	0,09
AUTONORIA SPAIN 2023 FONDO DE TITULIZA E1R+5.25% 30-09-41	EUR	1 500 000	1 294 974,62	0,12
AUTONORIA SPAIN 2023 FONDO DE TITULIZA E1R+6.9% 30-09-41	EUR	700 000	611 289,52	0,06
AVOCA CLO XIII E3R+2.4% 15-04-34	EUR	3 000 000	3 044 105,55	0,28
BILBAO CLO II DAC E3R+2.1% 20-08-35	EUR	4 115 000	4 137 962,11	0,39
COMPARTIMENT BL CONSUMER CREDIT 2024 E1R+0.9% 25-09-41	EUR	1 800 000	1 788 135,68	0,17
COMPARTIMENT BL CONSUMER CREDIT 2024 E1R+1.5% 25-09-41	EUR	1 900 000	1 900 016,68	0,18
COMPARTIMENT BL CONSUMER CREDIT 2024 E1R+2.5% 25-09-41	EUR	2 350 000	2 369 070,69	0,22

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
COMPARTIMENT BL CONSUMER CREDIT 2024 E1R+4.1% 25-09-41	EUR	2 150 000	2 204 326,99	0,21
CVC CORDATUS LOAN FUND XXIX DAC E3R+3.1% 15-02-37	EUR	2 000 000	2 018 877,93	0,19
CVC CORDATUS LOAN FUND XXIX DAC E3R+5.4% 15-02-37	EUR	2 000 000	2 032 850,22	0,19
DELPHINUS 2023I BV E3R+0.46% 22-03-02	EUR	7 200 000	7 069 072,78	0,66
DILOSK RMBS NO 8 STS DAC E3R+0.65% 20-05-62	EUR	10 130 000	9 275 838,63	0,87
DILOSK RMBS NO 8 STS DAC E3R+0.9% 20-05-62	EUR	968 000	961 007,17	0,09
DILOSK RMBS NO 8 STS DAC E3R+1.9% 20-05-62	EUR	900 000	910 553,40	0,09
DILOSK RMBS NO 8 STS DAC E3R+2.9% 20-05-62	EUR	600 000	611 305,74	0,06
FORTUNA CONSUMER LOAN ABS 20242 E1R+0.72% 18-10-34	EUR	13 000 000	13 032 341,77	1,20
FORTUNA CONSUMER LOAN ABS 20242 E1R+1.65% 18-10-34	EUR	2 700 000	2 714 662,33	0,25
FORTUNA CONSUMER LOAN ABS 20242 E1R+1.9% 18-10-34	EUR	4 300 000	4 303 539,69	0,40
FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 20241 E3R+1.8% 20-09-38	EUR	5 900 000	5 931 672,64	0,56
FT SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 20191 1.48% 20-12-35	EUR	10 500 000	5 925 492,54	0,55
GAMMA E3R+1.9% 26-02-34	EUR	3 700 000	3 713 372,54	0,35
GAMMA E3R+3.4% 26-02-34	EUR	2 100 000	2 108 772,05	0,20
GREEN LION 20241 BV E3R 23-10-60	EUR	8 500 000	8 510 071,93	0,80
GREEN STORM 2024 BV E3R+0.36% 22-02-71	EUR	10 200 000	10 157 532,64	0,95
LANTERNA FINANCE SRL 0.4% 28-04-50	EUR	13 000 000	2 942 998,28	0,28
LUSI 4 B E3R 15/09/48	EUR	6 435 000	2 235 865,62	0,21
LUSITANO MORTGAGES NO 4 E3R+0.56% 15-09-48	EUR	8 495 000	2 903 403,53	0,27
MILA 20241 A E1R+1.45% 16-09-41	EUR	420 000	419 060,57	0,04
MORTIMER 2024MIX SONIO+1.55% 22-09-67	GBP	3 350 000	4 045 609,54	0,38
MORTIMER 2024MIX SONIO+2.1% 22-09-67	GBP	1 768 000	2 135 035,24	0,20
NEUBERGER BERMAN LOAN ADV EURO CLO 3 E3R+0.92% 25-10-34	EUR	6 600 000	6 595 442,85	0,62
NEUBERGER BERMAN LOAN ADV EURO CLO 3 E3R+2.25% 25-10-34	EUR	3 000 000	3 049 165,43	0,29
NEUBERGER BERMAN LOAN ADVISERS EURO CLO E3R+0.88% 17-04-34	EUR	3 500 000	3 513 878,03	0,33
NYKREDIT 0.5% 01-10-40	DKK	3 822 213,28	435 103,06	0,04
NYKREDIT 1.0% 01-10-50	DKK	4 242 891,73	459 758,46	0,04
NYKREDIT 1.5% 01-10-50	DKK	2 281 410,62	254 710,83	0,02
NYKREDIT 1.5% 01-10-50	DKK	3 174 146,66	364 339,73	0,03
NYKREDIT 1.5% 01-10-53	DKK	2 770 321,5	303 042,20	0,03
NYKREDIT 2.0% 01-10-53	DKK	2 654 954,29	307 345,27	0,03
NYKREDIT 3.0% 01-10-47	DKK	3 899 263,2	522 520,15	0,05
NYKREDIT 3.0% 01-10-53	DKK	7 562 719,04	981 700,17	0,09
NYKREDIT 3.0% 01-10-53	DKK	7 952 137,98	1 017 327,00	0,10
NYKREDIT 5.0% 01-10-53	DKK	4 544 392,81	628 033,96	0,06
NYKREDIT REALKREDIT AS 3.0% 01-10-44	DKK	2 493 421,05	337 469,42	0,03
PIXEL 2021 E3R+2.7% 25-02-38	EUR	3 000 000	776 822,94	0,07
SABADELL CONSUMO 1 FDT E1R+3.3% 22-10-35	EUR	1 400 000	1 426 253,42	0,13
SABADELL CONSUMO 1 FDT E3R+1.4% 24-03-31	EUR	1 100 000	57 980,72	0,01
SABADELL CONSUMO 1 FDT E3R+2.45% 24-03-31	EUR	6 700 000	353 826,18	0,03
SABADELL CONSUMO 2 FDT E1R+7.75% 24-12-34	EUR	2 700 000	1 105 583,66	0,10
SABADELL CONSUMO 2 FDT E1R+9.25% 24-12-34	EUR	1 000 000	409 350,66	0,04

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SC GERMANY CONSUMER 20241 E1R+1.3% 14-01-38	EUR	2 400 000	2 396 413,76	0,22
SC GERMANY CONSUMER 20241 E1R+1.75% 14-01-38	EUR	8 800 000	8 783 779,25	0,82
SC GERMANY CONSUMER 20241 E1R+3.6% 14-01-38	EUR	3 100 000	3 158 722,89	0,30
SC GERMANY CONSUMER 20241 E1R+4.8% 14-01-38	EUR	1 300 000	980 697,67	0,09
SC GERMANY CONSUMER 20242 D E1R+1.7% 14-05-38	EUR	1 500 000	1 501 253,63	0,14
SC GERMANY SA COMPARTMENT LEASING 20231 E1R+1.3% 14-12-32	EUR	5 400 000	5 426 347,86	0,51
SC GERMANY SA COMPARTMENT LEASING 20231 E1R+3.0% 14-12-32	EUR	1 700 000	1 723 061,12	0,16
SC GERMANY SA COMPARTMENT LEASING 20231 E1R+5.3% 14-12-32	EUR	2 000 000	2 028 970,40	0,19
SUNRISE SPV 50 SRL E1R+1.0% 27-07-48	EUR	2 200 000	2 083 346,92	0,19
TITULIZACION DE ACTIVOS 22MIXTO FTA E3R+0.37% 28-06-46	EUR	2 300 000	2 241 944,24	0,21
TITULIZACION DE ACTIVOS 22MIXTO FTA E3R+0.45% 28-06-46	EUR	5 500 000	4 344 032,46	0,41
VITA SCIENTIA 20221 DAC E3R+1.3% 27-08-25	EUR	6 996 000	6 961 096,57	0,65
VITA SCIENTIA 20221 DAC E3R+1.8% 27-08-25	EUR	2 400 000	2 347 838,00	0,22
Sociétés d'investissement immobilier (SII)			36 767 535,23	3,44
PARAGON MORTGAGES NO12 E3R+0.24% 15-11-38	EUR	37 694 000	6 006 768,85	0,56
PARAGON MORTGAGES NO12 E3R+0.48% 15-11-38	EUR	11 254 000	4 247 861,21	0,40
PARAGON MORTGAGES NO12 E3R+0.92% 15-11-38	EUR	9 531 000	3 537 078,03	0,33
PARAGON MORTGAGES NO12 SONIO+0.3593% 15-11-38	GBP	30 000 000	5 772 781,97	0,54
PARAGON MORTGAGES NO12 SONIO+0.5993% 15-11-38	GBP	8 000 000	3 641 300,37	0,34
SAECURE BV E3R+0.4% 28-01-91	EUR	11 700 000	11 210 240,89	1,05
TDA 19MIXTO FONDO DE TITULIZACION DE E3R+3.5% 22-03-36	EUR	2 500 000	2 351 503,91	0,22
Sociétés d'investissement immobilier cotées (SIIC)			42 876 465,67	4,01
BBVA CONSUMER AUTO 20181 FTA 1.1% 20-07-31	EUR	12 500 000	10 325 496,54	0,97
BBVA CONSUMER AUTO 20181 FTA 4.1% 20-07-31	EUR	9 500 000	9 453 721,38	0,88
CAPITAL FOUR CLO IV DAC E3R+3.4% 15-04-38	EUR	4 600 000	4 729 932,06	0,44
CONTEGO CLO IX DAC E3R+2.15% 24-01-34	EUR	1 500 000	1 518 008,25	0,14
GREEN LION 20231 BV E3R+0.45% 23-07-65	EUR	16 800 000	16 849 307,44	1,58
TITRES D'OPC			62 868 639,98	5,88
OPCVM			43 106 001,00	4,03
Gestion collective			43 106 001,00	4,03
AMUNDI ABS AAA Part I C	EUR	50	10 179 332,00	0,95
AMUNDI EURO LIQUIDITY SHORT TERM SRI part E-C	EUR	1,18	12 309,99	0,00
AMUNDI EURO LIQUIDITY SHORT TERM SRI PART Z C	EUR	308,302	32 914 359,01	3,08
Autres OPC et fonds d'investissement			19 762 638,98	1,85
Gestion collective			19 762 638,98	1,85
AUTONORIA 23 CL D E1R 3.05	EUR	1 000 000	609 742,70	0,06
CARS ALLIANCE AUTO LOANS GERMANY E1R+1.2% 23-10-34	EUR	4 600 000	4 595 296,09	0,43
FCT PIXEL 2021 E3R+1.75% 25-02-38	EUR	200 000	51 386,19	0,00
HARMONY FRENCH HOME LOAN E3R+1.25% 27-05-62	EUR	1 600 000	1 601 709,56	0,15
HARMONY FRENCH HOME LOANS FCT 20211 E3R+0.95% 27-05-61	EUR	5 300 000	5 288 919,88	0,50

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
NORIA 2021-1 C	EUR	400 000	130 998,64	0,01
NORIA 2021-1 D	EUR	2 900 000	948 364,85	0,09
NORIA 2021-1 E	EUR	9 100 000	2 970 173,75	0,28
NORIA 2021-1 F	EUR	10 500 000	3 411 716,28	0,32
PIXEL 2021-1 B	EUR	600 000	154 331,04	0,01
Total			1 073 968 764,03	100,52

(*) Le secteur d'activité représente l'activité principale de l'émetteur de l'instrument financier ; il est issu de sources fiables reconnues au plan international (GICS et NACE principalement).

Inventaire des opérations à terme de devises

Type d'opération	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)			
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)	
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)
V DKK EUR 05/12/24	3 992,51		EUR	8 988 011,12	DKK	-8 984 018,61
V GBP EUR 05/12/24		-251 654,05	EUR	61 118 922,08	GBP	-61 370 576,13
Total	3 992,51	-251 654,05		70 106 933,20		-70 354 594,74

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions exprimé dans la devise de comptabilisation.

Inventaire des instruments financiers à terme

Inventaire des instruments financiers à terme - actions

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.				
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total				

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

Inventaire des instruments financiers à terme - taux d'intérêts

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
EURO BOBL 1224	-175		-203 000,00	-20 973 750,00
Sous-total 1.			-203 000,00	-20 973 750,00
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total			-203 000,00	-20 973 750,00

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

Inventaire des instruments financiers à terme - de change

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.				
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total				

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

Inventaire des instruments financiers à terme - sur risque de crédit

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.				
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
ITRAXX XOVER S42 V1	-20 000 000		-1 929 316,22	-20 000 000,00
Sous-total 4.			-1 929 316,22	-20 000 000,00
Total			-1 929 316,22	-20 000 000,00

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

Inventaire des instruments financiers à terme - autres expositions

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.				
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total				

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

Inventaire des instruments financiers à terme ou des opérations à terme de devises utilisés en couverture d'une catégorie de part

Type d'opération	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 (*)		
G4-A-GBP/EUR-161224	0,28		GBP	118,30	EUR	-118,02	FR0013234028	
G4-A-GBP/EUR-161224	0,20		GBP	51,77	EUR	-51,57	FR001400C2G4	
G4-A-GBP/EUR-161224	0,64		GBP	115,39	EUR	-114,75	FR0013234028	
G4-A-GBP/EUR-161224	0,95		GBP	229,99	EUR	-229,04	FR001400C2G4	
G4-A-GBP/EUR-161224	0,32		GBP	177,82	EUR	-177,50	FR0013234028	
G4-A-GBP/EUR-161224	542,29		GBP	245 118,95	EUR	-244 576,66	FR001400C2G4	
G4-A-GBP/EUR-161224	0,01		GBP	13,70	EUR	-13,69	FR0013234028	
G4-A-GBP/EUR-161224	0,01		GBP	10,55	EUR	-10,54	FR001400C2G4	
G4-A-GBP/EUR-161224			-0,02	GBP	50,25	EUR	-50,27	FR0013234028
G4-A-GBP/EUR-161224	0,03		GBP	26,26	EUR	-26,23	FR001400C2G4	
G4-A-GBP/EUR-161224	0,03		GBP	129,38	EUR	-129,35	FR0013234028	
G4-V-GBP/EUR-161224			-0,53	EUR	78,05	GBP	-78,58	FR001400C2G4
Total	544,76		-0,55		246 120,41		-245 576,20	

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions exprimé dans la devise de comptabilisation.

Synthèse de l'inventaire

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	1 073 968 764,03
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	-247 661,54
Total instruments financiers à terme - actions	
Total instruments financiers à terme - taux	-203 000,00
Total instruments financiers à terme - change	
Total instruments financiers à terme - crédit	-1 929 316,22
Total instruments financiers à terme - autres expositions	
Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises	544,21
Autres actifs (+)	4 344 699,93
Autres passifs (-)	-7 507 783,78
Passifs de financement (-)	
Total = actif net	1 068 426 246,63

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part AMUNDI ABS D	EUR	4,001	200 008,93
Part AMUNDI ABS I3-C	EUR	1 429,479	114 270,25
Part AMUNDI ABS I-C	EUR	3 024,61181	276 840,52
Part AMUNDI ABS I-GBP	GBP	1,000	204 551,46
Part AMUNDI ABS L	EUR	43 021,061	111,73
Part AMUNDI ABS M-D	EUR	569,047	104 327,19
Part AMUNDI ABS R-C	EUR	22 322,526	113,05

MENTIONS LÉGALES

Amundi Asset Management

Siège social : 91-93 boulevard Pasteur - 75015 Paris - France.

Adresse postale : 91-93 boulevard Pasteur CS21564 75730 Paris Cedex 15 - France.

Tél. +33 (0)1 76 33 30 30- amundi.com

Société par Actions Simplifiée - SAS au capital de 1 143 615 555 euros - Société de Gestion de Portefeuille agréée par l'AMF sous le numéro GP 04 000 036.

Siren : 437 574 452 RCS Paris - Siret : 43757445200029 - Code APE : 6630 Z - N° Identification

TVA : FR58437574452.

Amundi
Investment Solutions

La confiance, ça se mérite