

# **FCP de droit français HSBC MONETAIRE**

## **Rapport semestriel au 30 décembre 2024**

*(Document périodique non certifié par le Commissaire aux Comptes)*

# FCP HSBC MONETAIRE

## Etat du patrimoine en EUR

| Eléments de l'état du patrimoine                                                                           | Montant à l'arrêté<br>périodique (*) |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--------------------------------------|
| a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier | 275 610 917,29                       |
| b) Avoirs bancaires                                                                                        | 17 275 206,50                        |
| c) Autres actifs détenus par l'OPC                                                                         | 54 564 997,83                        |
| d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)                                                       | 347 451 121,62                       |
| e) Passif                                                                                                  | -32 029,73                           |
| f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)                                             | 347 419 091,89                       |

(\*) 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<br>en circulation | Valeur nette<br>d'inventaire par part |
|-------------------------|--------------|----------------------|-----------------------------------|---------------------------------------|
| HSBC MONETAIRE C en EUR | C            | 345 598 271,97       | 106 086                           | 3 257,7180                            |
| HSBC MONETAIRE Z en EUR | C            | 1 820 819,92         | 1 730,000                         | 1 052,4971                            |

# FCP HSBC MONETAIRE

## Elément du portefeuille titres

| Eléments du portefeuille titres                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | Pourcentage actif net<br>(*) | Pourcentage total des<br>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.<br><br>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.                      | 51,33                        | 51,33                                |
| 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. | 28,00                        | 28,00                                |
| 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.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                              |                                      |

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

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

# FCP HSBC MONETAIRE

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

| Titres       | Devise | En montant (EUR)      | Pourcentage actif net (*) | Pourcentage total des actifs (**) |
|--------------|--------|-----------------------|---------------------------|-----------------------------------|
| Euro         | EUR    | 275 610 917,29        | 79,33                     | 79,32                             |
| <b>TOTAL</b> |        | <b>275 610 917,29</b> | <b>79,33</b>              | <b>79,32</b>                      |

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

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

# FCP HSBC MONETAIRE

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

| Pays         | Pourcentage actif net<br>(*) | Pourcentage total des<br>actifs (**) |
|--------------|------------------------------|--------------------------------------|
| FRANCE       | 32,07                        | 32,07                                |
| ROYAUME-UNI  | 13,30                        | 13,30                                |
| BELGIQUE     | 6,32                         | 6,32                                 |
| ETATS-UNIS   | 5,72                         | 5,72                                 |
| PAYS-BAS     | 4,63                         | 4,63                                 |
| FINLANDE     | 4,34                         | 4,34                                 |
| CANADA       | 4,34                         | 4,34                                 |
| ALLEMAGNE    | 2,84                         | 2,84                                 |
| NORVEGE      | 2,32                         | 2,32                                 |
| SUEDE        | 2,01                         | 2,01                                 |
| AUSTRALIE    | 1,45                         | 1,45                                 |
| <b>TOTAL</b> | <b>79,33</b>                 | <b>79,32</b>                         |

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

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

# FCP HSBC MONETAIRE

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

| Nature d'actifs                                                   | Pourcentage actif net<br>(*) | Pourcentage total des<br>actifs (**) |
|-------------------------------------------------------------------|------------------------------|--------------------------------------|
| OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne |                              |                                      |
| Autres OPC et fonds d'investissements                             |                              |                                      |
| FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne   |                              |                                      |
| Autres                                                            |                              |                                      |
| <b>TOTAL</b>                                                      |                              |                                      |

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

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

# FCP HSBC MONETAIRE

## 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.<br><br>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.                      | 695 545 859,23          | 716 518 302,54 |
| 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. | 304 690 325,94          | 306 500 000,00 |
| 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.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                         |                |

# FCP HSBC MONETAIRE

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

| Prêts de titres | Emprunts de titres | Mise en pension | Prise en pension | TRS |
|-----------------|--------------------|-----------------|------------------|-----|
|-----------------|--------------------|-----------------|------------------|-----|

### a) Titres et matières premières prêtés

|                      |  |  |  |  |  |
|----------------------|--|--|--|--|--|
| Montant              |  |  |  |  |  |
| % de l'Actif Net (*) |  |  |  |  |  |

(\*) % hors trésorerie et équivalent de trésorerie

### b) Actifs engagés pour chaque type d'opérations de financement sur titres et TRS exprimés en valeur absolue

|                  |  |  |  |               |  |
|------------------|--|--|--|---------------|--|
| Montant          |  |  |  | 53 999 998,99 |  |
| % de l'Actif Net |  |  |  | 15,54         |  |

### c) 10 principaux émetteurs de garanties reçues (hors cash) pour tous les types d'opérations de financement

|                                              |  |  |  |               |  |
|----------------------------------------------|--|--|--|---------------|--|
| FRANCE GOVERNMENT BOND<br>OAT<br>FRANCE      |  |  |  | 25 163 766,44 |  |
| REPUBLIQUE FRANCAISE<br>PRESIDENCE<br>FRANCE |  |  |  | 13 066 577,92 |  |
| BELGIUM GOVERNMENT BOND<br>BELGIQUE          |  |  |  | 10 006 938,74 |  |
| IRELAND GOVERNMENT BOND<br>IRLANDE           |  |  |  | 5 981 373,20  |  |

### d) 10 principales contreparties en valeur absolue des actifs et des passifs sans compensation

|                             |  |  |  |               |  |
|-----------------------------|--|--|--|---------------|--|
| LA BANQUE POSTALE<br>FRANCE |  |  |  | 47 999 998,99 |  |
| NATIXIS<br>FRANCE           |  |  |  | 6 000 000,00  |  |

### e) Type et qualité des garanties (collatéral)

| Type          |  |  |  |               |  |
|---------------|--|--|--|---------------|--|
| - Actions     |  |  |  |               |  |
| - Obligations |  |  |  | 54 218 656,30 |  |
| - OPC         |  |  |  |               |  |
| - TCN         |  |  |  |               |  |
| - Cash        |  |  |  |               |  |
| Rating        |  |  |  |               |  |

# FCP HSBC MONETAIRE

| Prêts de titres | Emprunts de titres | Mise en pension | Prise en pension | TRS |
|-----------------|--------------------|-----------------|------------------|-----|
|-----------------|--------------------|-----------------|------------------|-----|

| Monnaie de la garantie |  |  |  |               |  |
|------------------------|--|--|--|---------------|--|
| Euro                   |  |  |  | 54 218 656,30 |  |

## f) Règlement et compensation des contrats

|                       |   |  |  |   |  |
|-----------------------|---|--|--|---|--|
| Triparties            |   |  |  | X |  |
| Contrepartie centrale |   |  |  |   |  |
| Bilatéraux            | X |  |  | X |  |

## g) Échéance de la garantie ventilée en fonction des tranches

|                    |  |  |  |               |  |
|--------------------|--|--|--|---------------|--|
| Moins d'1 jour     |  |  |  |               |  |
| 1 jour à 1 semaine |  |  |  |               |  |
| 1 semaine à 1 mois |  |  |  |               |  |
| 1 à 3 mois         |  |  |  | 10 050 157,22 |  |
| 3 mois à 1 an      |  |  |  |               |  |
| Plus d'1 an        |  |  |  | 23 073 516,66 |  |
| Ouvertes           |  |  |  | 21 094 982,42 |  |

## h) Échéance des opérations de financement sur titres et TRS ventilée en fonction des tranches

|                    |  |  |  |               |  |
|--------------------|--|--|--|---------------|--|
| Moins d'1 jour     |  |  |  |               |  |
| 1 jour à 1 semaine |  |  |  |               |  |
| 1 semaine à 1 mois |  |  |  |               |  |
| 1 à 3 mois         |  |  |  | 9 999 999,77  |  |
| 3 mois à 1 an      |  |  |  |               |  |
| Plus d'1 an        |  |  |  | 22 999 999,46 |  |
| Ouvertes           |  |  |  | 20 999 999,76 |  |

## i) Données sur la réutilisation des garanties

|                                                                             |  |  |  |  |  |
|-----------------------------------------------------------------------------|--|--|--|--|--|
| Montant maximal (%)                                                         |  |  |  |  |  |
| Montant utilisé (%)                                                         |  |  |  |  |  |
| Revenus pour l'OPC suite au réinvestissement des garanties espèces en euros |  |  |  |  |  |

# FCP HSBC MONETAIRE

| Prêts de titres | Emprunts de titres | Mise en pension | Prise en pension | TRS |
|-----------------|--------------------|-----------------|------------------|-----|
|-----------------|--------------------|-----------------|------------------|-----|

## j) Données sur la conservation des garanties reçues par l'OPC

|             |  |  |               |  |
|-------------|--|--|---------------|--|
| Caceis Bank |  |  |               |  |
| Titres      |  |  | 54 218 656,30 |  |
| Cash        |  |  |               |  |

## k) Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC

|        |  |  |  |  |
|--------|--|--|--|--|
| Titres |  |  |  |  |
| Cash   |  |  |  |  |

## l) Données sur les revenus et les coûts ventilés

| Revenus        |  |  |  |            |  |
|----------------|--|--|--|------------|--|
| - OPC          |  |  |  | 900 225,35 |  |
| - Gestionnaire |  |  |  |            |  |
| - Tiers        |  |  |  |            |  |
| Coûts          |  |  |  |            |  |
| - OPC          |  |  |  |            |  |
| - Gestionnaire |  |  |  |            |  |
| - Tiers        |  |  |  |            |  |

## e) Données Type et qualité des garanties (collatéral)

La nature des titres pris en garantis est définie par les politiques internes du groupe HSBC. Pour l'OPC considéré, il s'agit de titre gouvernementaux ou assimilés présentant une bonne qualité du point de vue du risque de crédit.

## i) Données sur la réutilisation des garanties

Non concerné.

## k) Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC

Pour chaque contrepartie, la gestion du collatéral est définie au contrat cadre (CSA) en accord avec les politiques HSBC de risque et juridique.

Ce contrat cadre définit la forme du collatéral (espèces, titres et haircut associés), montant minimum de transfert pour les appels de marge ainsi que la franchise applicable.

## l) Données sur les revenus et les coûts ventilés

L'intégralité des revenus concernés bénéficient à l'OPC.

L'intégralité des coûts concernés sont supportés par l'OPC.

# FCP HSBC MONETAIRE

## 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  |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------|-----------------------|--------------|
| <b>OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES</b>                                                |        |                     | <b>15 082 596,11</b>  | <b>4,34</b>  |
| <b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b> |        |                     | <b>15 082 596,11</b>  | <b>4,34</b>  |
| <b>Banques commerciales</b>                                                             |        |                     | <b>9 070 197,50</b>   | <b>2,61</b>  |
| CAN IMP BK E3R+0.2% 17-07-25                                                            | EUR    | 9 000 000           | 9 070 197,50          | 2,61         |
| <b>Marches de capitaux</b>                                                              |        |                     | <b>6 012 398,61</b>   | <b>1,73</b>  |
| NATL BANK OF CANADA OISEST+0.27% 25-09-25                                               | EUR    | 1 000 000           | 999 420,49            | 0,29         |
| NATL BANK OF CANADA OISEST+0.3% 18-11-25                                                | EUR    | 5 000 000           | 5 012 978,12          | 1,44         |
| <b>TITRES DE CRÉANCES</b>                                                               |        |                     | <b>260 528 321,18</b> | <b>74,99</b> |
| <b>Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>                 |        |                     | <b>209 790 015,18</b> | <b>60,39</b> |
| <b>Banques commerciales</b>                                                             |        |                     | <b>73 816 280,60</b>  | <b>21,26</b> |
| BNP PA OISEST+0.135% 21-02-25                                                           | EUR    | 4 000 000           | 4 014 647,29          | 1,16         |
| BNP PA OISEST+0.17% 20-03-25                                                            | EUR    | 5 000 000           | 5 048 283,23          | 1,45         |
| BNP PA OISEST+0.26% 14-03-25                                                            | EUR    | 6 000 000           | 6 190 698,55          | 1,78         |
| BQ POS OISEST+0.265% 22-01-25                                                           | EUR    | 3 000 000           | 3 113 493,67          | 0,90         |
| BRED OISEST+0.13% 06-01-25                                                              | EUR    | 3 000 000           | 3 007 394,41          | 0,87         |
| CA OISEST+0.27% 27-01-25                                                                | EUR    | 3 000 000           | 3 090 824,87          | 0,89         |
| CITI NATL ASSO LON ZCP 06-01-25                                                         | EUR    | 6 000 000           | 5 997 010,49          | 1,73         |
| COOP R OISEST+0.27% 27-06-25                                                            | EUR    | 7 000 000           | 7 137 314,19          | 2,05         |
| DNB BA OISEST+0.15% 22-04-25                                                            | EUR    | 8 000 000           | 8 050 395,76          | 2,32         |
| HSBC B OISEST+0.31% 15-10-25                                                            | EUR    | 3 000 000           | 3 023 024,87          | 0,87         |
| ING BA OISEST+0.295% 01-08-25                                                           | EUR    | 1 000 000           | 1 015 651,77          | 0,29         |
| MUFG B OISEST+0.17% 12-02-25                                                            | EUR    | 5 000 000           | 5 070 811,20          | 1,46         |
| NATL A OISEST+0.15% 23-04-25                                                            | EUR    | 5 000 000           | 5 030 999,22          | 1,45         |
| SG OISEST+0.185% 03-04-25                                                               | EUR    | 4 000 000           | 4 048 635,72          | 1,17         |
| SUMI MITS TRUS BAN ZCP 16-01-25                                                         | EUR    | 7 000 000           | 6 990 421,57          | 2,01         |
| SUMI MITS TRUS BAN ZCP 21-02-25                                                         | EUR    | 3 000 000           | 2 986 673,79          | 0,86         |
| <b>Electricité</b>                                                                      |        |                     | <b>9 981 145,22</b>   | <b>2,87</b>  |
| RTE EDF TRANSPORT ZCP 16-01-25                                                          | EUR    | 5 000 000           | 4 993 362,16          | 1,44         |
| RTE EDF TRANSPORT ZCP 27-01-25                                                          | EUR    | 2 000 000           | 1 995 513,09          | 0,57         |
| RTE EDF TRANSPORT ZCP 31-01-25                                                          | EUR    | 3 000 000           | 2 992 269,97          | 0,86         |
| <b>Equipements et fournitures médicaux</b>                                              |        |                     | <b>9 983 394,29</b>   | <b>2,87</b>  |
| ESSILORLUXOTTICA ZCP 20-01-25                                                           | EUR    | 10 000 000          | 9 983 394,29          | 2,87         |
| <b>Marches de capitaux</b>                                                              |        |                     | <b>20 153 018,39</b>  | <b>5,80</b>  |
| NORD B OISEST+0.16% 18-02-25                                                            | EUR    | 6 000 000           | 6 103 413,40          | 1,76         |
| NORD B OISEST+0.22% 26-06-25                                                            | EUR    | 4 000 000           | 4 036 710,93          | 1,16         |
| OVER C OISEST+0.19% 12-06-25                                                            | EUR    | 5 000 000           | 5 007 856,76          | 1,44         |
| ROYA B OISEST+0.3% 17-12-25                                                             | EUR    | 5 000 000           | 5 005 037,30          | 1,44         |

# FCP HSBC MONETAIRE

## Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)                          | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle      | % Actif Net  |
|-----------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------|----------------------|--------------|
| <b>Services aux collectivités</b>                                           |        |                     | <b>51 307 148,86</b> | <b>14,77</b> |
| AGEN C OISEST+0.08% 12-02-25                                                | EUR    | 3 500 000           | 3 525 999,79         | 1,01         |
| AGEN C OISEST+0.25% 06-06-25                                                | EUR    | 10 000 000          | 10 021 730,00        | 2,90         |
| AGEN C OISEST+0.25% 30-06-25                                                | EUR    | 3 000 000           | 3 000 263,75         | 0,86         |
| DUTC TREA CERT ZCP 28-05-25                                                 | EUR    | 8 000 000           | 7 918 549,80         | 2,28         |
| FINLAND TBILL ZCP 13-05-25                                                  | EUR    | 5 000 000           | 4 951 650,03         | 1,43         |
| FLEMISH COM ZCP 21-01-25                                                    | EUR    | 10 000 000          | 9 982 879,36         | 2,87         |
| FRENCH REPUBLIC ZCP 07-05-25                                                | EUR    | 10 000 000          | 9 910 081,43         | 2,85         |
| REGI AUVE RHON ZCP 24-01-25                                                 | EUR    | 2 000 000           | 1 995 994,70         | 0,57         |
| <b>Services aux professionnels</b>                                          |        |                     | <b>2 981 259,68</b>  | <b>0,86</b>  |
| UNEDIC ZCP 25-03-25                                                         | EUR    | 3 000 000           | 2 981 259,68         | 0,86         |
| <b>Services financiers diversifiés</b>                                      |        |                     | <b>41 567 768,14</b> | <b>11,96</b> |
| BANQ F OISEST+0.19% 17-03-25                                                | EUR    | 1 500 000           | 1 520 390,67         | 0,44         |
| BANQ F OISEST+0.32% 02-01-25                                                | EUR    | 10 000 000          | 10 407 919,33        | 2,98         |
| NATI OISEST+0.18% 14-03-25                                                  | EUR    | 1 500 000           | 1 520 582,65         | 0,44         |
| NATI OISEST+0.26% 02-07-25                                                  | EUR    | 7 000 000           | 7 009 253,34         | 2,02         |
| NATI OISEST+0.26% 07-04-25                                                  | EUR    | 2 000 000           | 2 043 576,55         | 0,59         |
| SUMI MITS BANK COR ZCP 20-01-25                                             | EUR    | 5 000 000           | 4 991 550,41         | 1,44         |
| SUMI MITS BANK COR ZCP 24-03-25                                             | EUR    | 3 000 000           | 2 979 392,53         | 0,86         |
| SUMI MITS BANK COR ZCP 28-01-25                                             | EUR    | 4 000 000           | 3 990 496,41         | 1,15         |
| THE TO ESTR+0.31% 08-08-25                                                  | EUR    | 7 000 000           | 7 104 606,25         | 2,04         |
| <b>Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b> |        |                     | <b>50 738 306,00</b> | <b>14,60</b> |
| <b>Banques commerciales</b>                                                 |        |                     | <b>12 003 854,10</b> | <b>3,46</b>  |
| BNP PA OISEST+0.15% 30-03-25                                                | EUR    | 2 000 000           | 2 016 924,35         | 0,58         |
| DZ BANK AG DEUT ZE ZCP 25-04-25                                             | EUR    | 5 000 000           | 4 955 988,07         | 1,43         |
| MUFG B OISEST+0.14% 24-01-25                                                | EUR    | 5 000 000           | 5 030 941,68         | 1,45         |
| <b>Industrie aérospatiale et défense</b>                                    |        |                     | <b>9 963 820,26</b>  | <b>2,87</b>  |
| HONEYWELL INTL ZCP 12-02-25                                                 | EUR    | 10 000 000          | 9 963 820,26         | 2,87         |
| <b>Marches de capitaux</b>                                                  |        |                     | <b>4 997 491,26</b>  | <b>1,44</b>  |
| SATELLITE SAS ZCP 06-01-25                                                  | EUR    | 5 000 000           | 4 997 491,26         | 1,44         |
| <b>Services aux collectivités</b>                                           |        |                     | <b>6 975 736,84</b>  | <b>2,01</b>  |
| KINGDOM OF SWEDEN ZCP 12-02-25                                              | EUR    | 7 000 000           | 6 975 736,84         | 2,01         |
| <b>Services financiers diversifiés</b>                                      |        |                     | <b>16 797 403,54</b> | <b>4,82</b>  |
| COLL COMM PAPE III ZCP 21-05-25                                             | EUR    | 10 000 000          | 9 895 548,36         | 2,84         |
| LMA ZCP 04-02-25                                                            | EUR    | 2 000 000           | 1 994 152,70         | 0,57         |
| NRWBANK ZCP 30-09-25                                                        | EUR    | 5 000 000           | 4 907 702,48         | 1,41         |

# FCP HSBC MONETAIRE

## Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)                               | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle       | % Actif Net  |
|----------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------|-----------------------|--------------|
| <b>TITRES FINANCIERS REÇUS EN PENSION</b>                                        |        |                     | <b>53 999 998,99</b>  | <b>15,54</b> |
| Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé |        |                     | <b>53 999 998,99</b>  | <b>15,54</b> |
| Services aux collectivités                                                       |        |                     | <b>53 999 998,99</b>  | <b>15,54</b> |
| BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 22-06-28                                            | EUR    | 10 493 179          | 9 999 999,59          | 2,88         |
| FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.0% 25-11-30                                         | EUR    | 17 751 479          | 14 999 999,76         | 4,31         |
| FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.1% 01-03-25                                         | EUR    | 8 459 521           | 9 999 999,77          | 2,88         |
| IRELAND GOVERNMENT BOND 0.0% 18-10-31                                            | EUR    | 7 060 000           | 6 000 000,00          | 1,73         |
| OAT 2.75% 25/10/2027                                                             | EUR    | 12 871 287          | 12 999 999,87         | 3,74         |
| <b>INDEMNITÉS SUR TITRES REÇUS EN PENSION</b>                                    |        |                     | <b>208 534,74</b>     | <b>0,06</b>  |
| <b>Total</b>                                                                     |        |                     | <b>329 819 451,02</b> | <b>94,93</b> |

(\*) 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 (*) |
| <b>Total</b>     |                                    |        |                             |             |                      |             |

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

# FCP HSBC MONETAIRE

## 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 | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>Total</b>                 |                     |                                    |        |                             |

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

# FCP HSBC MONETAIRE

## 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           | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |                  |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     |                                    |                  |                             |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |                  |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     |                                    |                  |                             |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |                  |                             |
| OISEST/0.0/FIX/2.513         | 7 905 000           | 757,71                             |                  | 7 905 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/2.609         | 9 858 000           | 811,30                             |                  | 9 858 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/2.626         | 4 930 000           | 1 064,55                           |                  | 4 930 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/2.678         | 4 940 000           | 444,79                             |                  | 4 940 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/2.693         | 9 859 016           | 762,57                             |                  | 9 859 016,00                |
| OISEST/0.0/FIX/2.737         | 4 928 244           | 1 103,57                           |                  | 4 928 244,00                |
| OISEST/0.0/FIX/2.758         | 2 972 000           | 250,23                             |                  | 2 972 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/2.935         | 4 960 000           | 454,88                             |                  | 4 960 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/2.979         | 9 912 713           | 758,78                             |                  | 9 912 713,00                |
| OISEST/0.0/FIX/3.016         | 3 900 000           | 427,95                             |                  | 3 900 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/3.025         | 1 984 028           | 31,98                              |                  | 1 984 028,00                |
| OISEST/0.0/FIX/3.032         | 2 967 554           |                                    | -275,16          | 2 967 554,00                |
| OISEST/0.0/FIX/3.537         | 5 900 000           |                                    | -3 647,28        | 5 900 000,00                |
| SWAP 2.23 09/30/25           | 4 907 000           |                                    | -331,47          | 4 907 000,00                |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     | <b>6 868,31</b>                    | <b>-4 253,91</b> | <b>79 923 555,00</b>        |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |                  |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     |                                    |                  |                             |
| <b>Total</b>                 |                     | <b>6 868,31</b>                    | <b>-4 253,91</b> | <b>79 923 555,00</b>        |

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

# FCP HSBC MONETAIRE

## 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 | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>Total</b>                 |                     |                                    |        |                             |

(\*) 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 | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>Total</b>                 |                     |                                    |        |                             |

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

# FCP HSBC MONETAIRE

## 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 | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>Total</b>                 |                     |                                    |        |                             |

(\*) 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

L'OPC sous revue n'est pas concerné par cette rubrique.

## Synthèse de l'inventaire

|                                                                                      | Valeur actuelle présentée au bilan |
|--------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|
| Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)                          | 329 819 451,02                     |
| Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :               |                                    |
| Total opérations à terme de devises                                                  |                                    |
| Total instruments financiers à terme - actions                                       |                                    |
| Total instruments financiers à terme - taux                                          | 2 614,40                           |
| Total instruments financiers à terme - change                                        |                                    |
| Total instruments financiers à terme - crédit                                        |                                    |
| Total instruments financiers à terme - autres expositions                            |                                    |
| Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises |                                    |
| Autres actifs (+)                                                                    | 17 624 802,29                      |
| Autres passifs (-)                                                                   | -27 775,82                         |
| Passifs de financement (-)                                                           |                                    |
| <b>Total = actif net</b>                                                             | <b>347 419 091,89</b>              |

| Libellé de la part    | Devise de la part | Nombre de parts | Valeur liquidative |
|-----------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| Part HSBC MONETAIRE C | EUR               | 106 086         | 3 257,7180         |
| Part HSBC MONETAIRE Z | EUR               | 1 730,000       | 1 052,4971         |