



ATTESTATION DU COMMISSAIRE AUX COMPTES
Composition de l'actif au 28 juin 2024

HSBC EURO PROTECT 8o +
OPCVM CONSTITUE SOUS FORME DE FONDS COMMUN DE PLACEMENT
Régi par le Code monétaire et financier

Société de gestion
HSBC GLOBAL ASSET MANAGEMENT (FRANCE)
Immeuble Coeur Défense - Tour A
110 Esplanade du Général de Gaulle
92400 La Défense 4 - Courbevoie

En notre qualité de commissaire aux comptes de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement HSBC EURO PROTECT 8o +, et en application des dispositions de l'article L.214-17 du Code monétaire et financier et de l'article 411-125 du Règlement général de l'Autorité des marchés financiers relatives au contrôle de la composition de l'actif, nous avons établi la présente attestation sur les informations figurant dans la composition de l'actif au 28 juin 2024 ci-jointe.

Ces informations ont été établies sous la responsabilité de la société de gestion. Il nous appartient de nous prononcer sur la cohérence des informations contenues dans la composition de l'actif avec la connaissance que nous avons de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Nous avons mis en œuvre les diligences que nous avons estimé nécessaires au regard de la doctrine professionnelle de la Compagnie nationale des commissaires aux comptes relative à cette mission. Ces diligences, qui ne constituent ni un audit ni un examen limité, ont consisté essentiellement à réaliser des procédures analytiques et des entretiens avec les personnes qui produisent et contrôlent les informations données.

Sur la base de nos travaux, nous n'avons pas d'observation à formuler sur la cohérence des informations figurant dans le document joint avec la connaissance que nous avons de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Neuilly sur Seine, date de la signature électronique

Document authentifié par signature électronique

Le commissaire aux comptes
PricewaterhouseCoopers Audit
Amaury Couplez

PricewaterhouseCoopers Audit, 63, rue de Villiers, 92208 Neuilly-sur-Seine Cedex
T: +33 (0) 1 56 57 58 59, F: +33 (0) 1 56 57 58 60, www.pwc.fr

Société d'expertise comptable inscrite au tableau de l'ordre de Paris - Ile de France. Société de commissariat aux comptes membre de la compagnie régionale de Versailles. Société par Actions Simplifiée au capital de 2 510 460 €. Siège social : 63, rue de Villiers 92200 Neuilly-sur-Seine. RCS Nanterre 672 006 483. TVA n° FR 76 672 006 483. Siret 672 006 483 00362. Code APE 6920 Z. Bureaux : Bordeaux, Grenoble, Lille, Lyon, Marseille, Metz, Nantes, Nice, Paris, Poitiers, Rennes, Rouen, Strasbourg, Toulouse.

V A L E U R	STATUTS DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P.R.U EN DEVISE	DATE	COURS	I	<-----	Devise du portefeuille	----->	PRCT
VAL/LIGNE		EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR. COURS	COTA	VALEUR	F	PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL ACT NET

0 -ACTIONS & VALEURS ASSIMILEES

ACTIONS & VALEURS ASSIMILEES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE OU ASSIMILE

ACTIONS & VALEURS ASSIMILEES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE OU ASSIMILE

DEVISE VALEUR : EUR EURO

NL0011540547	ABN AMRO BANK-CV	37,324.	P EUR	16.425	M 28/06/24	15.29	613,046.70	570,683.96	0.00	-42,362.74	3.83
NL0012969182	ADYEN NV	487.	P EUR	1325.5764	M 28/06/24	1115.4	645,555.73	543,199.80	0.00	-102,355.93	3.65
NL0013267909	AKZO NOBEL	9,531.	P EUR	64.32	M 28/06/24	56.68	613,033.92	540,217.08	0.00	-72,816.84	3.63
LU1598757687	ARCELORMITTAL	24,350.	P EUR	23.92	M 28/06/24	21.39	582,452.00	520,846.50	0.00	-61,605.50	3.50
NL0010273215	ASML HOLDING NV	719.	P EUR	853.	M 28/06/24	966.8	613,307.00	695,129.20	0.00	81,822.20	4.67
DE000BASF111	BASF SE	12,501.	P EUR	49.04	M 28/06/24	45.23	613,049.04	565,420.23	0.00	-47,628.81	3.80
NL0012866412	BE SEMICONDUCTOR IND	4,662.	P EUR	131.5	M 28/06/24	156.3	613,053.00	728,670.60	0.00	115,617.60	4.89
DE0005140008	DEUTSCHE BANK AG NAM	37,573.	P EUR	15.502	M 28/06/24	14.82	582,456.65	556,831.86	0.00	-25,624.79	3.74
NL0000009165	HEINEKEN	6,515.	P EUR	94.1	M 28/06/24	90.4	613,061.50	588,956.00	0.00	-24,105.50	3.96
DE0006070006	HOCHTIEF	5,907.	P EUR	103.8	M 28/06/24	106.1	613,146.60	626,732.70	0.00	13,586.10	4.21
NL0011821202	ING GROEP NV	37,903.	P EUR	16.174	M 28/06/24	15.928	613,043.12	603,718.98	0.00	-9,324.14	4.05
NL0000009082	KONINKLIJKE KPN NV	178,312.	P EUR	3.438	M 28/06/24	3.572	613,036.66	636,930.46	0.00	23,893.80	4.28
NL0011794037	KONINKLIJKE AHOLD NV	20,531.	P EUR	28.5494	M 28/06/24	27.63	586,148.30	567,271.53	0.00	-18,876.77	3.81
DE0006599905	MERCK KGA	3,968.	P EUR	154.5	M 28/06/24	155.	613,056.00	615,040.00	0.00	1,984.00	4.13
NL0010558797	OCI NV REG	24,900.	P EUR	24.62	M 28/06/24	22.88	613,038.00	569,712.00	0.00	-43,326.00	3.83
NL0013654783	PROSUS NV	17,692.	P EUR	30.415	M 28/06/24	33.335	538,102.37	589,762.82	0.00	51,660.45	3.96
NL0000379121	RANDSTAD	12,268.	P EUR	49.0586	M 28/06/24	42.35	601,851.25	519,549.80	0.00	-82,301.45	3.49
NL0000009538	ROYAL PHILIPS	24,289.	P EUR	25.24	M 28/06/24	23.62	613,054.36	573,706.18	0.00	-39,348.18	3.85
DE0007037129	RWE AG	17,790.	P EUR	34.46	M 28/06/24	32.11	613,043.40	571,236.90	0.00	-41,806.50	3.84
DE000ENER6Y0	SIEMENS ENERGY A	25,343.	P EUR	24.19	M 28/06/24	24.38	613,047.17	617,862.34	0.00	4,815.17	4.15
NL00150001Y2	UNIVERSAL MUSIC	20,093.	P EUR	28.99	M 28/06/24	27.93	582,496.07	561,197.49	0.00	-21,298.58	3.77
NL0000395903	WOLTERS KLUWER	8,126.	P EUR	147.1214	M 28/06/24	154.75	1,195,508.70	1,257,498.50	0.00	61,989.80	8.45
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO											
CUMUL (EUR)							13,897,587.54	13,620,174.93	0.00	-277,412.61	91.48

II -TITRES DE CREANCES

TITRES DE CREANCES NEGOCIES SUR MARCHE REGLEMENTE OU ASSIMILE

BONS DU TRESOR

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FR0128227784	FRAN TREA ZCP 09-24 NOL	(999) 180924	20,000.	EUR	98.2833	12/06/24	3.654	L	19,656.65	19,837.17	0.00	180.52	0.13
--------------	-------------------------	--------------	---------	-----	---------	----------	-------	---	-----------	-----------	------	--------	------

VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHES A TERME

ENGAGEMENTS A TERME FERMES

FUTURES SUR INDICES

SOUS-JACENT : AEX AMSTERDAM AEX INDEX

FINL0000081N AEX FUT 0724	5.	EUR	926.65	M 28/06/24	926.5	0.00	-150.00	0.00	-150.00	0.00
SOUS-JACENT : CAC CAC 40 INDEX										
FINL0000082V CAC 40 FUT 0724	26.	EUR	7534.4423	M 28/06/24	7493.5	0.00	-10,645.00	0.00	-10,645.00	-0.07

V A L E U R	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<----- PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
SOUS-JACENT : DAX DAX 30 INDEX PERFORMANCE												
FINL000007UW	DAX 30 IND FU 0924	3.	EUR	18213.5	M 28/06/24	18429.		0.00	16,162.50	0.00	16,162.50	0.11
SOUS-JACENT : FTSEMIB FTSE MIB INDEX												
FINL000007UU	FTSE/MIB 0924	4.	EUR	32974.	M 28/06/24	33355.		0.00	7,620.00	0.00	7,620.00	0.05
SOUS-JACENT : IBEX MADRID IBEX 35 INDEX												
FINL00000826	MEFF IBEX35 E 0724	6.	EUR	10846.75	M 28/06/24	10880.		0.00	1,995.00	0.00	1,995.00	0.01
SOUS-JACENT : SX5E EURO STOXX 50												
FINL000007UX	EURO STOXX 50 0924	112.	EUR	4904.9955	M 28/06/24	4934.		0.00	32,485.00	0.00	32,485.00	0.22
FUTURES SUR INDICES												
CUMUL (EUR)								0.00	47,467.50	0.00	47,467.50	0.32
VII - AUTRES ENGAGEMENTS												
SWAPS												
SWAPS DE PERFORMANCE												
DATE ECHEANCE : 13/05/25												
PSW038117	EUR EM 0.00/PERF	NOL RECU	14,049,995.22	EUR	0.	28/06/24	3.819	0.00	53,656.93	53,656.93	0.00	0.36
		NOL VERSE	-14,049,995.22	EUR	0.	28/06/24	-3.05922012 M	0.00	429,820.28	0.00	429,820.28	2.89
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 13/05/25												
CUMUL (EUR)								0.00	483,477.21	53,656.93	429,820.28	3.25
AUTRES SWAPS												
DATE ECHEANCE : 07/05/29												
PSW035655	GAP SWAP 07/05/29	PRC	14,160,529.	EUR	0.	28/06/24	-0.17827512 M	0.00	-25,244.70	0.00	-25,244.70	-0.17
SWAPS												
CUMUL (EUR)								0.00	458,232.51	53,656.93	404,575.58	3.08
IX - TRESORERIE												
DETTES ET CREANCES												
COLLATERAL CASH SUR DERIVES LISTES												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
DGMCIEUR	Dépôt gar. CACEIS BK		797,388.02	EUR	1.	28/06/24	1.	797,388.02	797,388.02	0.00	0.00	5.36
APPELS DE MARGE												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
MARCIEUR	Appel Marge CACEIS		-35,997.5	EUR	1.	28/06/24	1.	-35,997.50	-35,997.50	0.00	0.00	-0.24

V A L E U R		STATUTS DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P.R.U EN DEVISE	DATE	COURS	I	<-----			Devise du portefeuille			----->			PRCT		
		VAL/LIGNE	EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR. COURS	COTA	VALEUR	F	PRIX	REVIENT	TOTA	VALEUR	BOURSIERE	COUPON	COURU	TOTA	PLUS	OU MOINS	VAL	ACT NET
FRAIS DE GESTION																				
DEVISE VALEUR : EUR EURO																				
FGDEPEUR	Prov com depositaire		-5,473.04	EUR	1.	28/06/24	1.			-5,473.04		-5,473.04				0.00			0.00	-0.04
FGPVAEUR	Frais de Gest. Admi		-3,122.38	EUR	1.	28/06/24	1.			-3,122.38		-3,122.38				0.00			0.00	-0.02
FGPVFEUR	Frais de Gest. Fixe		-11,645.65	EUR	1.	28/06/24	1.			-11,645.65		-11,645.65				0.00			0.00	-0.08
FGPVHEUR	Frais de Gest. H.C.C		-2,124.25	EUR	1.	28/06/24	1.			-2,124.25		-2,124.25				0.00			0.00	-0.01
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO																				
						CUMUL (EUR)					-22,365.32	-22,365.32				0.00			0.00	-0.15
AUTRES DETTES ET CREANCES																				
DEVISE VALEUR : EUR EURO																				
DBDEUR	Debiteurs Divers		4,723.22	EUR	1.	28/06/24	1.			4,723.22		4,723.22				0.00			0.00	0.03
DETTES ET CREANCES																				
						CUMUL (EUR)					743,748.42	743,748.42				0.00			0.00	5.00
DISPONIBILITES																				
AVOIRS																				
DEVISE VALEUR : EUR EURO																				
BQC1EUR	CACEIS Bank		24.29	EUR	1.	28/06/24	1.			24.29		24.29				0.00			0.00	0.00
IX - TRESORERIE																				
						CUMUL (EUR)					743,772.71	743,772.71				0.00			0.00	5.00
PORTEFEUILLE : HSBC EURO PROTECT 80 + (249026)																				
						(EUR)					14,661,016.90	14,889,484.82				53,656.93			174,810.99	100.00

Portefeuille titres :									
14,145,712.11									
Frais de gestion du jour									
Frais de Gest. Admi : 32.55 EUR									
Frais de Gest. H.C.C : 11.67 EUR									
Prov com depositaire : 28.48 EUR									
Frais de Gest. Fixe : 406.83 EUR									
Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
C1 FR0013387925 HSBC EUR PR 80 PL C	EUR	14,889,484.82	141,605.291	105.14	100.			108.29	105.14
Actif net total en EUR : 14,889,484.82									
Precedente VL en date du 27/06/24 :									
C1	HSBC EUR PR 80 PL C		Prec. VL :	105.39	(EUR)	Variation :	-0.237%		