

ATTESTATION DE LA COMPOSITION DE L'ACTIF au 28 juin 2024

MCA GESTOBLIG

Fonds Commun de Placement

CREDIT INDUSTRIEL ET COMMERCIAL (CIC)
6 avenue de Provence
75009 PARIS
Etablissement Dépositaire



Attestation de la composition de l'actif au 28 juin 2024

Mesdames, Messieurs,

En notre qualité de Commissaire aux comptes du Fonds Commun de Placement MCA GESTOBLIG, et en exécution des dispositions prévues par l'article L.214-8 du Code monétaire et financier et par l'article 38 VI de l'instruction n°2005-01 de l'AMF prise en application du Règlement général de l'AMF, nous avons vérifié la sincérité de la composition de l'actif telle qu'elle est jointe à la présente attestation.

La composition de l'actif a été établie sous la responsabilité de la société de gestion. Il nous appartient, sur la base de nos vérifications, d'en attester la sincérité.

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 ont consisté à vérifier la concordance des informations qui nous ont été données avec les documents de base dont elles sont issues.

Nous n'avons pas d'observation à formuler sur la sincérité des informations données dans les documents joints.

Fait à Paris, le 26 août 2024

Le Commissaire aux comptes

JPA



Pascal ROBERT

MCA GESTOBLIG

Document d'information périodique au 28/06/2024

Sommaire

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR	3
NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART OU ACTION	4
ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR	5
MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR	6
DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE	7
RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR DEVISE	8
RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR SECTEUR ÉCONOMIQUE	9
RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR	10
VENTILATION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE	11
COMMISSION DE PERFORMANCE	12
INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)	13
OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE	16
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS	17
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS	18
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE	19
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT	20
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS	21
OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	22
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	23
SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE	24

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR

Éléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier	36.352.197,99
b) Avoirs bancaires	2.474.872,51
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	4.291.768,55
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	43.118.839,05
e) Passif	-25.214,35
f) Valeur nette d'inventaire	43.093.624,70

SP
A

MCA GESTOBLIG

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

Code ISIN de la part	Libellé de la part	Affectation des sommes distribuables	Devise de la part	Actif net de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
FR0007004171	PART CAPI R	Capitalisable	EUR	43.093.624,70	232.525	185,32

SP
A

ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR

Eléments du portefeuille titres :	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier	84,36	84,31
b) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen	0,00	0,00
c) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières	0,00	0,00
d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Autres actifs	9,83	9,82

S
P
A

MCA GESTOBLIG

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

Éléments du portefeuille titres :	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
a) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier	9.668.650,04	14.112.530,58
b) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen	0,00	0,00
c) Titres financiers éligibles et instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières	0,00	0,00
d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Autres actifs	700.063,29	1.103.066,59

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	10.368.713,33
Cessions	15.215.597,17

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Pas de distribution sur la période.

SP
A

MCA GESTOBLIG

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

Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
		Actif net	Total des actifs
Euro	36.352.197,99	84,36	84,31
Total	36.352.197,99	84,36	84,31

SP
A

MCA GESTOBLIG

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

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Banques	28,89	28,87
Souverains	8,12	8,11
Finance générale	5,28	5,28
Automobiles et équipementiers	5,26	5,26
Aérospatial / Défense	5,10	5,10
Inv immobilier et serv	3,73	3,73
Banques	2,96	2,95
Immobilier	2,93	2,93
Equip serv/distrib prod pétro	2,80	2,80
Assurances multirisques	2,30	2,30
Ingénierie Industrielle	2,13	2,13
Electricité	2,10	2,10
ENERGIE ALTERNATIVE	1,93	1,93
Assurances	1,75	1,75
Commerce de détail	1,69	1,69
Média	1,64	1,64
Instr Invest autre que actions	1,63	1,62
Téléphonie mobile	1,57	1,57
Transport industriel	1,38	1,38
Services de soutien aux entreprises	1,17	1,17
Total	84,36	84,31

MCA GESTOBLIG

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

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	56,75	56,72
Luxembourg	6,91	6,91
États-Unis	4,45	4,45
Royaume-Uni	4,42	4,41
Allemagne	4,40	4,40
Espagne	2,77	2,77
Italie	2,56	2,56
Pays-Bas	2,10	2,09
Total	84,36	84,31

SP
A

MCA GESTOBLIG

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

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Parts d'OPC	9,83	9,82
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	9,83	9,82
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	0,00	0,00
Autres OPC et fonds d'investissements	0,00	0,00
Autres actifs	0,00	0,00
Total	9,83	9,82

UBA

MCA GESTOBLIG

COMMISSION DE PERFORMANCE

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

SP
A

MCA GESTOBLIG

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Obligations			36.352.197,99	84,36
Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			36.352.197,99	84,36
Aérospatial / Défense			2.199.130,03	5,10
AIRBUS 1,625%20-070425	EUR	700	691.970,14	1,60
ROLLS-ROYCE 4,625%20-160226	EUR	700	718.320,55	1,67
THALES 0,75%18-230125	EUR	8	788.839,34	1,83
Assurances			752.530,41	1,75
GROUPAMA 6%17-230127 OBL.ECH.	EUR	7	752.530,41	1,75
Assurances multirisques			992.701,64	2,30
BNP CARDIF 1%17-291124	EUR	10	992.701,64	2,30
Automobiles et équipementiers			2.268.527,00	5,26
CNHI 1 3/4 09/12/25	EUR	700	693.985,17	1,61
FORD MOT 1,744%24	EUR	800	812.223,96	1,88
RENAULT TPA 83-84	EUR	1.998	659.340,00	1,53
SCHAEFFLER 4,5%24-140826	EUR	1	102.977,87	0,24
Banques			1.273.361,30	2,96
BANQUE POSTALE TV20-170626	EUR	8	774.084,38	1,80
BNQ POSTALE 1%17-161024 EMTN	EUR	5	499.276,92	1,16
BANQUE STELL 3,875%23-190126	EUR	7	713.838,48	1,66
BFCM 3%15-110925	EUR	8	811.064,26	1,88
BNP PARIBAS 2,375%15-170225	EUR	1.000	998.175,14	2,32
BNP PARIBAS TV19-150725 EMTN	EUR	5	501.786,20	1,17
BPCE 0,625%19-260924 EMTN	EUR	7	697.886,99	1,62
BPCE 0,625%20-280425	EUR	5	488.206,51	1,13
BPCE 2,875%14-300924	EUR	8	814.624,26	1,89
BPCE 3,625%23-170426	EUR	5	504.173,98	1,17
BPCE 3%16-190726 EMTN	EUR	800.000	790.319,12	1,83
CA AUTO BK 4,375%23-080626	EUR	600	608.356,03	1,41
CA SA 2,85%16-270426	EUR	365.001	360.645,65	0,84
CIC TSIPDI 90	EUR	552.415	466.064,62	1,08
CR.AGRICOLE 2.8%16-210726 TSR	EUR	690.000	679.538,54	1,58
CRED.AGRIC.2,80%15-161025 TSR	EUR	523.000	517.049,87	1,20
CRED.AGRICOL.2,80%16-270126TSR	EUR	52.770	52.119,71	0,12
CRED.AGRICOLE 3%14-221224 TSR	EUR	830.000	826.485,13	1,92
CREDIT AGR.2,7% 15-150725	EUR	660.000	656.096,57	1,52
CREDIT AGR.2,70%15-140425 TSR	EUR	160.000	159.353,58	0,37
HSBC HLDGS TV20-131126	EUR	500	478.104,34	1,11
RCI BANQUE 4,625%23-021026	EUR	500	524.987,16	1,22
SOC.GENERAL02,625%15-270225	EUR	8	798.829,51	1,85
Commerce de détail			727.465,82	1,69
ALD 4,375%23-231126	EUR	7	727.465,82	1,69
Electricité			906.276,57	2,10
EDF 3,75%23-050627 EMTN	EUR	9	906.276,57	2,10

MCA GESTOBLIG

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
ENERGIE ALTERNATIVE			832.465,84	1,93
AKUO ENERGY 4%19-221125	EUR	850	832.465,84	1,93
Equip serv/distrib prod pétro			1.206.553,70	2,80
LINDE PLC 3,625%25	EUR	5	500.768,15	1,16
TECHNIPFMC TV20-300625	EUR	700	705.785,55	1,64
Finance générale			2.276.391,45	5,28
ARVAL SERV LEAS 4,625%23-1224	EUR	5	514.582,99	1,19
DIAC TPA MAR85	EUR	1.531	274.049,00	0,64
HLD EUROPE 4%18-311024	EUR	3	307.416,67	0,71
JEFFERIES GROUP 1%19-190724	EUR	600	604.851,31	1,40
PEUGEOT INVEST 1,875%19-301026	EUR	6	575.491,48	1,34
Immobilier			1.264.449,00	2,93
LANDEV1 TV20-311224	EUR	500	460.290,00	1,07
LANDEV1 TV21-201025	EUR	900	804.159,00	1,86
Ingénierie Industrielle			916.492,38	2,13
PACCAR FIN EURO 3,25%22-291125	EUR	200	202.976,07	0,47
TRATON FIN LUX 4,125%23-180125	EUR	7	713.516,31	1,66
Instr Invest autre que actions			700.348,05	1,63
DUFYR ONE 2,5%17-151024	EUR	700	700.348,05	1,63
Inv immobilier et serv			1.607.328,95	3,73
6E.SENS.IMMO. 4PCT22 15022025	EUR	70	686.838,67	1,59
CALAF 7%28012021	EUR	300	202.074,04	0,47
ILIAD 5,125%21-151026	EUR	400	405.864,72	0,94
RESIDE ET.INV.5%16-180225	EUR	6	312.551,52	0,73
Média			705.509,34	1,64
JC DECAUX 2%20-241024	EUR	7	705.509,34	1,64
Services de soutien aux entreprises			502.978,77	1,17
ELIS 4,125%22-240527	EUR	5	502.978,77	1,17
Souverains			3.499.108,53	8,12
ALLEMAGNE 0,5%15-150225	EUR	80.000.000	787.788,20	1,83
ALLEMAGNE 1%14-150824	EUR	100.000.000	1.005.847,81	2,33
OAT 1,75%14-25112024	EUR	1.700.000	1.705.472,52	3,96
Téléphonie mobile			678.529,20	1,57
CELLNEX FIN.0,75%151126	EUR	2	188.082,62	0,43
CELLNEX FINANCE 2,25%22-120426	EUR	5	490.446,58	1,14
Transport industriel			594.344,36	1,38
GETLINK 3,5%20-301025	EUR	100	99.189,44	0,23
MUNDYS 1,625%17-030225	EUR	500	495.154,92	1,15
Parts d'OPC et fonds d'investissements			4.235.768,55	9,83
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne			4.235.612,55	9,83
OPCVM			4.235.612,55	9,83
UNION + (IC)	EUR	21,274	4.235.612,55	9,83
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne			156,00	0,00

MCA GESTOBLIG

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Divers			156,00	0,00
SLGP CORPOR BDS CANTONNEME-C	EUR	15.600	156,00	0,00
Total			40.587.966,54	94,19

SP
A

OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE

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

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

SPA

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS

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

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

UBA

MCA GESTOBLIG

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS

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

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

UBA

MCA GESTOBLIG

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE

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

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

UBA

MCA GESTOBLIG

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT

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

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

SP
A

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS

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

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

S P A

MCA GESTOBLIG

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

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

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

SP
A

MCA GESTOBLIG

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

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

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

SP
A

SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	40.587.966,54
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	0,00
Total instruments financiers à terme - actions	0,00
Total instruments financiers à terme - taux	0,00
Total instruments financiers à terme - change	0,00
Total instruments financiers à terme - crédit	0,00
Total instruments financiers à terme - autres expositions	0,00
Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises	0,00
Autres actifs (+)	2.530.872,51
Autres passifs (-)	-25.214,35
Passifs de financement (-)	-
Total = actif net	43.093.624,70