

## **ATTESTATION DE LA COMPOSITION DE L'ACTIF au 30 juin 2026**

### **MCA EUROPE**

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 30 juin 2026

Mesdames, Messieurs,

En notre qualité de Commissaire aux comptes du Fonds Commun de Placement MCA EUROPE, 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 28 août 2026

Le Commissaire aux comptes

JPA



Pascal ROBERT

**MCA EUROPE**

**Document d'information périodique au 30/06/2026**

## 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 |
| INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE                                                   | 15 |
| INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS                                                      | 16 |
| INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS                                              | 17 |
| INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE                                                    | 18 |
| INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT                                         | 19 |
| INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS                                           | 20 |
| INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART) | 21 |
| INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)   | 22 |
| SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE                                                                      | 23 |

**ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR**

| Éléments 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 | 15 513 558,10                      |
| b) Avoirs bancaires                                                                                        | 113 814,18                         |
| c) Autres actifs détenus par l'OPCVM                                                                       | 733 729,84                         |
| d) Total des actifs détenus par l'OPCVM                                                                    | 16 361 102,12                      |
| e) Passif                                                                                                  | -31 153,53                         |
| f) Valeur nette d'inventaire                                                                               | 16 329 948,59                      |

\* Les montants sont signés

SP  
A

## MCA EUROPE

### 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 en devise de la part | Nombre de parts | Valeur liquidative en devise de la part |
|----------------------|--------------------|--------------------------------------|-------------------|-------------------------------------------|-----------------|-----------------------------------------|
| FR0007490164         | PART CAPI R        | Capitalisable                        | EUR               | 16 329 948,59                             | 54 203,000      | 301,27                                  |

SPA

## 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 95,00       | 94,82            |
| 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 4,46        | 4,45             |

SPA

## MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

| Eléments 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 4 312 933,46            | 1 831 356,85 |
| 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 1 205 777,37            | 720 081,01   |

| Mouvements intervenus au cours de la période | Mouvements (en montant) |
|----------------------------------------------|-------------------------|
| Acquisitions                                 | 5 518 710,83            |
| Cessions                                     | 2 551 437,86            |

### DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Pas de distribution sur la période.

SPA

## MCA EUROPE

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

| Devise           | En montant (EUR)     | Pourcentage  |                  |
|------------------|----------------------|--------------|------------------|
|                  |                      | Actif net    | Total des actifs |
| Euro             | 14 969 051,30        | 91,67        | 91,49            |
| Couronne danoise | 331 585,14           | 2,03         | 2,03             |
| Livre sterling   | 212 921,66           | 1,30         | 1,30             |
| <b>Total</b>     | <b>15 513 558,10</b> | <b>95,00</b> | <b>94,82</b>     |

SPA

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

| Secteur économique                                | Pourcentage  |                  |
|---------------------------------------------------|--------------|------------------|
|                                                   | Actif net    | Total des actifs |
| Matériel équipements destinés aux TI              | 19,44        | 19,40            |
| Banques                                           | 12,11        | 12,09            |
| Aérospatial et défense                            | 9,33         | 9,31             |
| Articles personnels                               | 6,59         | 6,57             |
| Logiciels et services informatiques               | 6,39         | 6,38             |
| Gaz eau et services multiples aux collectivités   | 4,53         | 4,52             |
| Industries généralistes                           | 4,48         | 4,47             |
| Assurance - Non vie                               | 4,39         | 4,38             |
| Équipements et services médicaux                  | 3,58         | 3,58             |
| Bâtiment et matériaux de construction             | 3,42         | 3,41             |
| Chimie                                            | 3,27         | 3,26             |
| Soins personnels pharmacies et épiceries          | 2,94         | 2,93             |
| Énergie non renouvelable                          | 2,50         | 2,49             |
| Électricité                                       | 2,14         | 2,14             |
| Transport industriel                              | 2,03         | 2,03             |
| Sociétés de placement immobilier                  | 1,57         | 1,57             |
| Investissement immobilier et services             | 1,44         | 1,44             |
| Pharmacie/biotechnologie/Producteurs de Marijuana | 1,30         | 1,30             |
| Agro-alimentaire                                  | 1,10         | 1,10             |
| Boissons                                          | 1,08         | 1,08             |
| Services appui à industrie                        | 0,75         | 0,75             |
| Voyages et Loisirs                                | 0,62         | 0,62             |
| <b>Total</b>                                      | <b>95,00</b> | <b>94,82</b>     |

## MCA EUROPE

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

| Pays         | Pourcentage  |                  |
|--------------|--------------|------------------|
|              | Actif net    | Total des actifs |
| France       | 56,15        | 56,04            |
| Allemagne    | 14,25        | 14,22            |
| Pays-Bas     | 12,10        | 12,08            |
| Espagne      | 7,58         | 7,57             |
| Danemark     | 2,03         | 2,03             |
| Suisse       | 1,58         | 1,58             |
| Royaume-Uni  | 1,31         | 1,30             |
| <b>Total</b> | <b>95,00</b> | <b>94,82</b>     |

SP  
A

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

| Nature d'actifs                                                   | Pourcentage |                  |
|-------------------------------------------------------------------|-------------|------------------|
|                                                                   | Actif net   | Total des actifs |
| <b>Parts d'OPC</b>                                                | <b>4,46</b> | <b>4,45</b>      |
| OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne | 4,46        | 4,45             |
| 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             |
| <b>Autres actifs</b>                                              | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>      |
| <b>Total</b>                                                      | <b>4,46</b> | <b>4,45</b>      |

DRAFT

## MCA EUROPE

### COMMISSION DE PERFORMANCE

| PART CAPI R                                 | 30/06/2026 |
|---------------------------------------------|------------|
| Commission de performance (frais variables) | 0,00       |
| Pourcentage de commission de performance*   | 0,00       |

\*Par rapport à l'actif net moyen

SPA

# MCA EUROPE

## INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

| Instruments                                                                         | Devise | Quantité | Montant              | %AN          |
|-------------------------------------------------------------------------------------|--------|----------|----------------------|--------------|
| <b>Actions et valeurs assimilées</b>                                                |        |          | <b>15 513 558,10</b> | <b>95,00</b> |
| <b>Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b> |        |          | <b>15 513 558,10</b> | <b>95,00</b> |
| Aérospatial et défense                                                              |        |          | 1 523 756,00         | 9,33         |
| AIRBUS                                                                              | EUR    | 3 400    | 661 436,00           | 4,05         |
| DASSAULT AVIATION                                                                   | EUR    | 600      | 172 320,00           | 1,05         |
| SAFRAN PROV.ECHANGE                                                                 | EUR    | 2 000    | 690 000,00           | 4,23         |
| Agro-alimentaire                                                                    |        |          | 179 350,00           | 1,10         |
| DANONE                                                                              | EUR    | 2 500    | 179 350,00           | 1,10         |
| Articles personnels                                                                 |        |          | 1 075 450,00         | 6,59         |
| ADIDAS NOM.                                                                         | EUR    | 700      | 125 580,00           | 0,77         |
| HERMES INTERNATIONAL                                                                | EUR    | 140      | 223 720,00           | 1,37         |
| LVMH MOET HENNESSY VUITTON                                                          | EUR    | 1 500    | 726 150,00           | 4,45         |
| Assurance - Non vie                                                                 |        |          | 716 170,00           | 4,39         |
| ALLIANZ                                                                             | EUR    | 1 200    | 496 920,00           | 3,05         |
| AXA                                                                                 | EUR    | 5 000    | 219 250,00           | 1,34         |
| Banques                                                                             |        |          | 1 977 952,00         | 12,11        |
| BANCO SANTANDER                                                                     | EUR    | 63 000   | 761 292,00           | 4,66         |
| BNP PARIBAS ACTIONS A                                                               | EUR    | 9 500    | 970 330,00           | 5,94         |
| CREDIT AGRICOLE                                                                     | EUR    | 14 000   | 246 330,00           | 1,51         |
| Bâtiment et matériaux de construction                                               |        |          | 558 792,00           | 3,42         |
| SAINT-GOBAIN                                                                        | EUR    | 2 700    | 213 732,00           | 1,31         |
| VINCI                                                                               | EUR    | 2 700    | 345 060,00           | 2,11         |
| Boissons                                                                            |        |          | 176 628,00           | 1,08         |
| REMY COINTREAU                                                                      | EUR    | 4 100    | 176 628,00           | 1,08         |
| Chimie                                                                              |        |          | 533 702,40           | 3,27         |
| AIR LIQUIDE                                                                         | EUR    | 3 080    | 533 702,40           | 3,27         |
| Electricité                                                                         |        |          | 349 440,00           | 2,14         |
| IBERDROLA                                                                           | EUR    | 16 000   | 349 440,00           | 2,14         |
| Energie non renouvelable                                                            |        |          | 408 180,00           | 2,50         |
| TOTALENERGIES SE                                                                    | EUR    | 6 000    | 408 180,00           | 2,50         |
| Equipements et services médicaux                                                    |        |          | 585 330,40           | 3,58         |
| ESSILORLUXOTTICA                                                                    | EUR    | 3 568    | 585 330,40           | 3,58         |
| Gaz eau et services multiples aux collectivités                                     |        |          | 740 250,00           | 4,53         |
| ENGIE                                                                               | EUR    | 9 000    | 248 310,00           | 1,52         |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT                                                                | EUR    | 13 500   | 491 940,00           | 3,01         |
| Industries généralistes                                                             |        |          | 730 990,00           | 4,48         |
| SIEMENS                                                                             | EUR    | 2 600    | 730 990,00           | 4,48         |
| Investissement immobilier et services                                               |        |          | 235 072,00           | 1,44         |
| GECINA                                                                              | EUR    | 1 200    | 88 260,00            | 0,54         |
| VONOVIA SE                                                                          | EUR    | 6 800    | 146 812,00           | 0,90         |
| Logiciels et services informatiques                                                 |        |          | 1 043 837,00         | 6,39         |
| AMADEUS IT GROUP CL.A                                                               | EUR    | 2 500    | 127 700,00           | 0,78         |
| DASSAULT SYSTEMES                                                                   | EUR    | 11 800   | 210 217,00           | 1,29         |
| PROSUS NV                                                                           | EUR    | 8 000    | 303 920,00           | 1,86         |

## MCA EUROPE

### INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

| Instruments                                                              | Devise | Quantité | Montant              | %AN          |
|--------------------------------------------------------------------------|--------|----------|----------------------|--------------|
| SAP                                                                      | EUR    | 3 000    | 402 000,00           | 2,46         |
| Matériel équipements destinés aux TI                                     |        |          | 3 173 724,00         | 19,44        |
| ASML HOLDING                                                             | EUR    | 900      | 1 549 260,00         | 9,49         |
| INFINEON TECHNOLOGIES                                                    | EUR    | 5 200    | 424 684,00           | 2,60         |
| SCHNEIDER ELECTRIC                                                       | EUR    | 3 300    | 941 820,00           | 5,77         |
| STMICROELECTRONICS                                                       | EUR    | 4 000    | 257 960,00           | 1,58         |
| Pharmacie/biotechnologie/Producteurs de Marijuana                        |        |          | 212 921,66           | 1,30         |
| ASTRAZENECA PLC                                                          | GBP    | 1 300    | 212 921,66           | 1,30         |
| Services appui à industrie                                               |        |          | 123 060,00           | 0,75         |
| ADYEN                                                                    | EUR    | 150      | 123 060,00           | 0,75         |
| Sociétés de placement immobilier                                         |        |          | 256 125,00           | 1,57         |
| UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD                                                | EUR    | 2 500    | 256 125,00           | 1,57         |
| Soins personnels pharmacies et épiceries                                 |        |          | 479 562,50           | 2,94         |
| L'OREAL                                                                  | EUR    | 1 250    | 479 562,50           | 2,94         |
| Transport industriel                                                     |        |          | 331 585,14           | 2,03         |
| DSV                                                                      | DKK    | 1 600    | 331 585,14           | 2,03         |
| Voyages et Loisirs                                                       |        |          | 101 680,00           | 0,62         |
| ACCOR                                                                    | EUR    | 2 000    | 101 680,00           | 0,62         |
| <b>Parts d'OPC et fonds d'investissements</b>                            |        |          | <b>728 629,84</b>    | <b>4,46</b>  |
| <b>OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne</b> |        |          | <b>728 629,84</b>    | <b>4,46</b>  |
| AMUNDI EUROSTOXX 50                                                      | EUR    | 4 000    | 287 960,00           | 1,76         |
| UNION PLUS                                                               | EUR    | 2,1      | 440 669,84           | 2,70         |
| <b>Total</b>                                                             |        |          | <b>16 242 187,94</b> | <b>99,46</b> |

## MCA EUROPE

### INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE

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

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

SPA

## MCA EUROPE

### INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS

| Instruments financiers à terme – actions |                  |                                    |          |                                     |
|------------------------------------------|------------------|------------------------------------|----------|-------------------------------------|
| Libellé instrument                       | Quantité/Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |          | Montant de l'exposition en Euro (*) |
|                                          |                  | Actif                              | Passif   | +/-                                 |
| Futures                                  |                  |                                    |          |                                     |
| Sous total                               |                  | 0,00                               | 0,00     | 0,00                                |
| Options                                  |                  |                                    |          |                                     |
| BN1/0726/CALL/104.                       | -15,00           | 0,00                               | 2 235,00 | -59 598,69                          |
| Sous total                               |                  | 0,00                               | 2 235,00 | -59 598,69                          |
| Swaps                                    |                  |                                    |          |                                     |
| Sous total                               |                  | 0,00                               | 0,00     | 0,00                                |
| Autres instruments                       |                  |                                    |          |                                     |
| Sous total                               |                  | 0,00                               | 0,00     | 0,00                                |
| Total                                    |                  | 0,00                               | 2 235,00 | -59 598,69                          |

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

## MCA EUROPE

### 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 en Euro (*) |
|                                                  |                  | 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.

DRAFT

## MCA EUROPE

### 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 en Euro (*) |
|                                            |                  | 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.

DRAFT

## MCA EUROPE

### 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 en Euro (*) |
|                                                       |                  | 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.

## MCA EUROPE

### 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 en Euro (*) |
|                                                     |                  | 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.

DRAFT

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

| Libellé instrument | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition en Euro (*) |             |                      |             | 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.

SPA

## MCA EUROPE

### 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 en Euro (*) | 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.

DRAFT

## SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

|                                                                                             | Valeur actuelle présentée au bilan |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)</b>                          | 16 242 187,94                      |
| <b>Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :</b>               |                                    |
| Total opérations à terme de devises                                                         | 0,00                               |
| Total instruments financiers à terme - actions                                              | -2 235,00                          |
| 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                               |
| <b>Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises</b> | 0,00                               |
| <b>Autres actifs (+)</b>                                                                    | 118 914,18                         |
| <b>Autres passifs (-)</b>                                                                   | -28 918,53                         |
| <b>Total = actif net</b>                                                                    | <b>16 329 948,59</b>               |