



Les marchés financiers en toute sérénité



Cartographie des couvertures

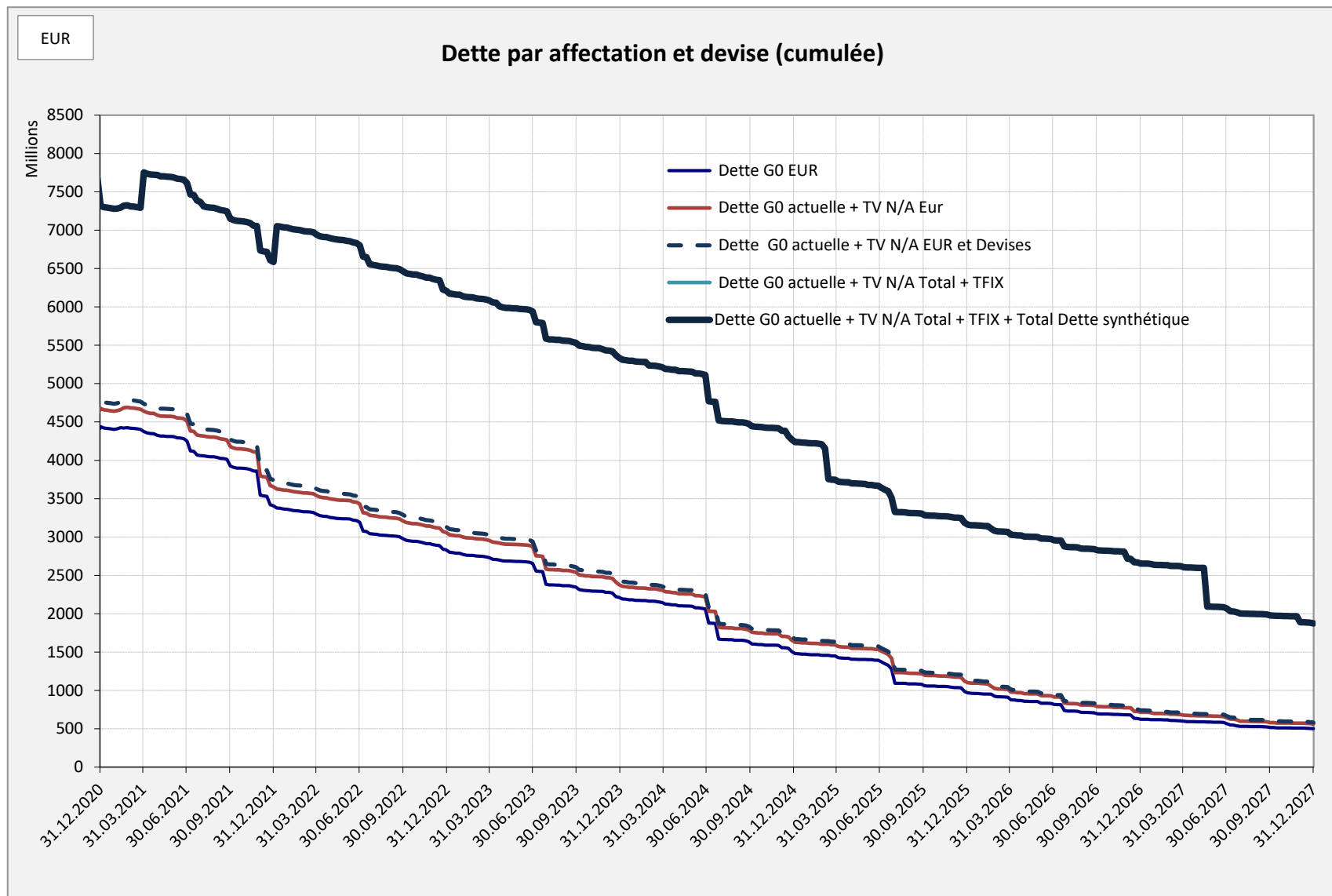
30 Juin 2021

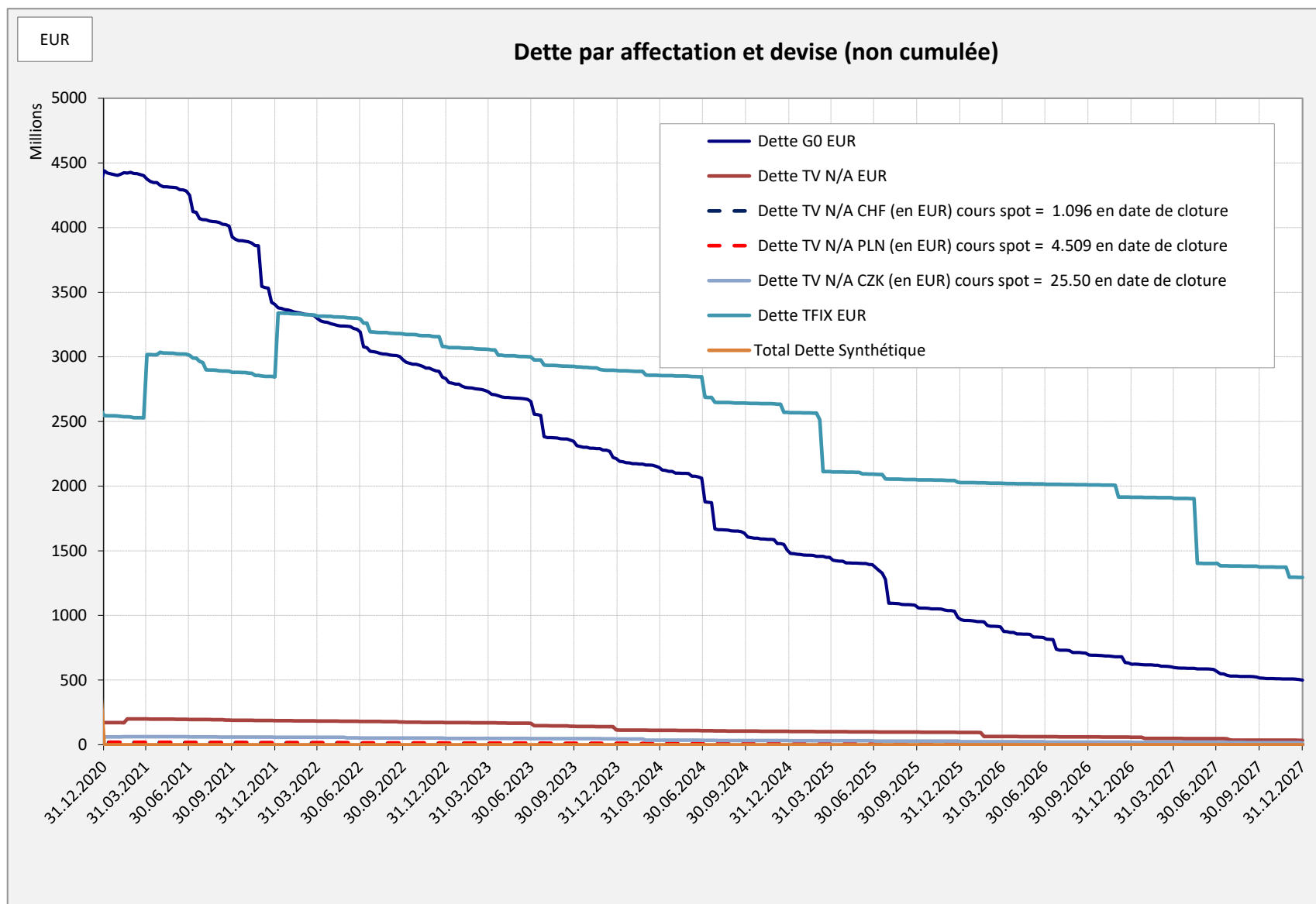
KERIUS Finance SAS

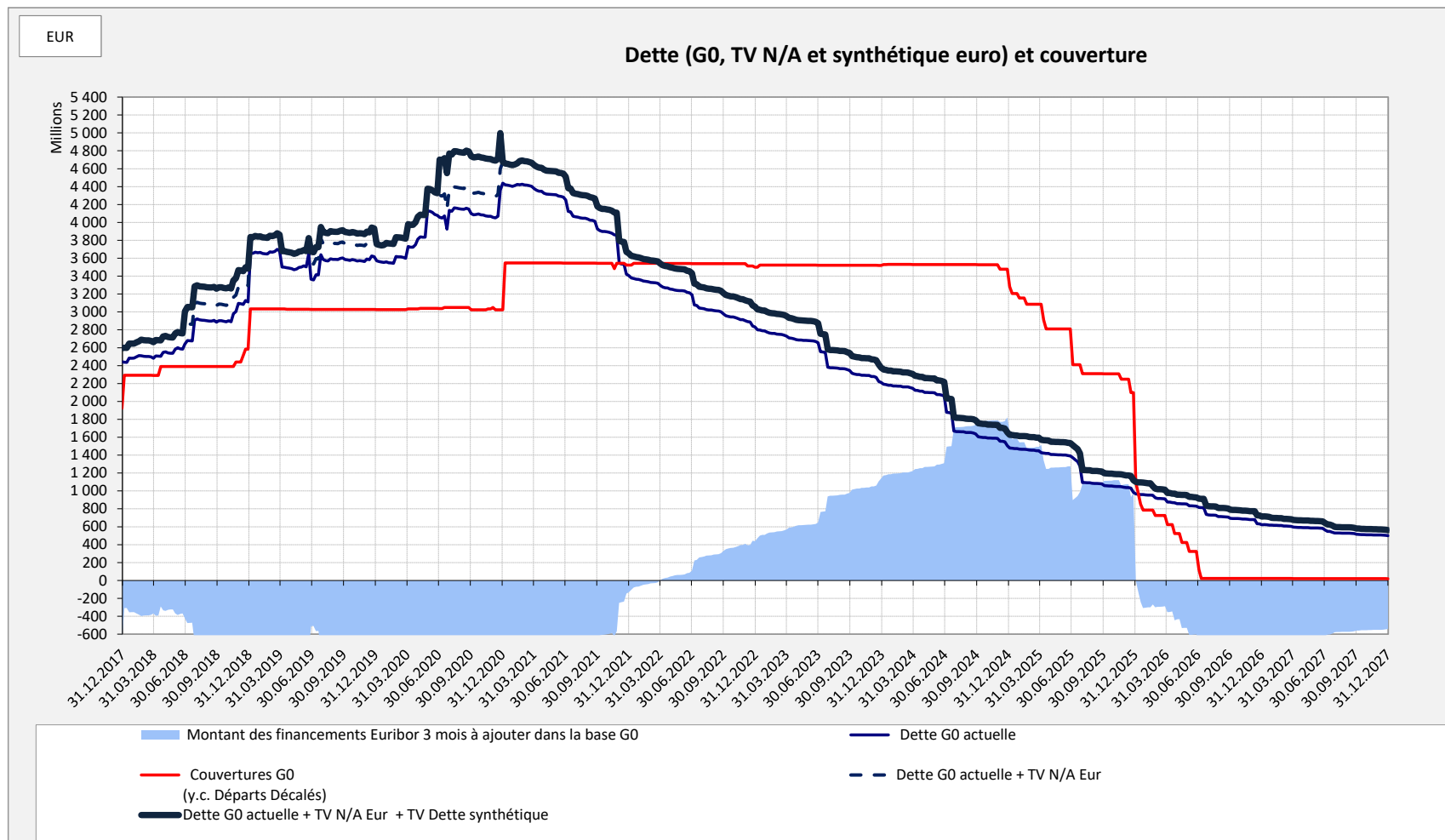
Conseiller en Investissements Financiers

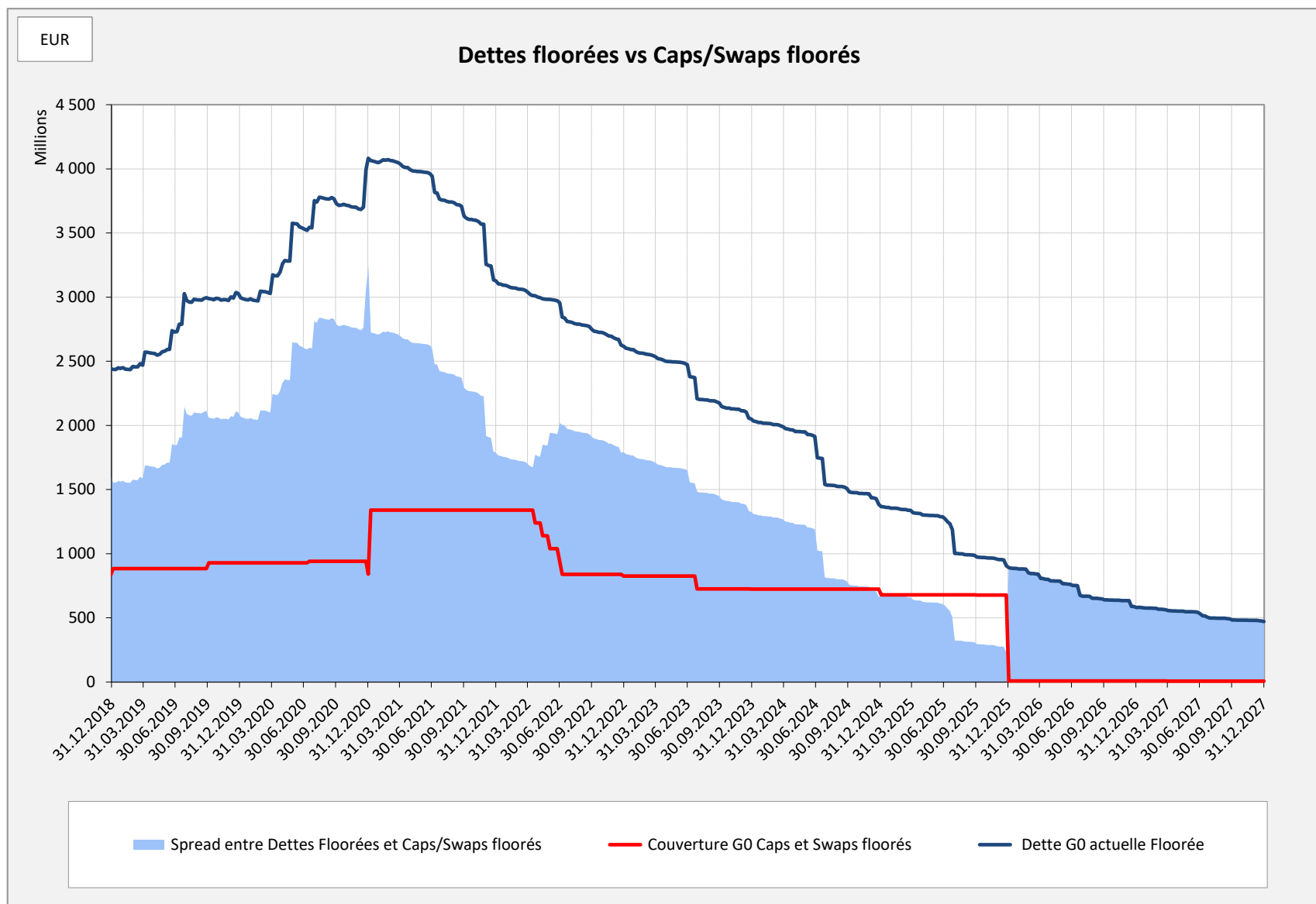
Membre de l'ANACOFI CIF- Association agréée par l'AMF - ORIAS N° 13000716

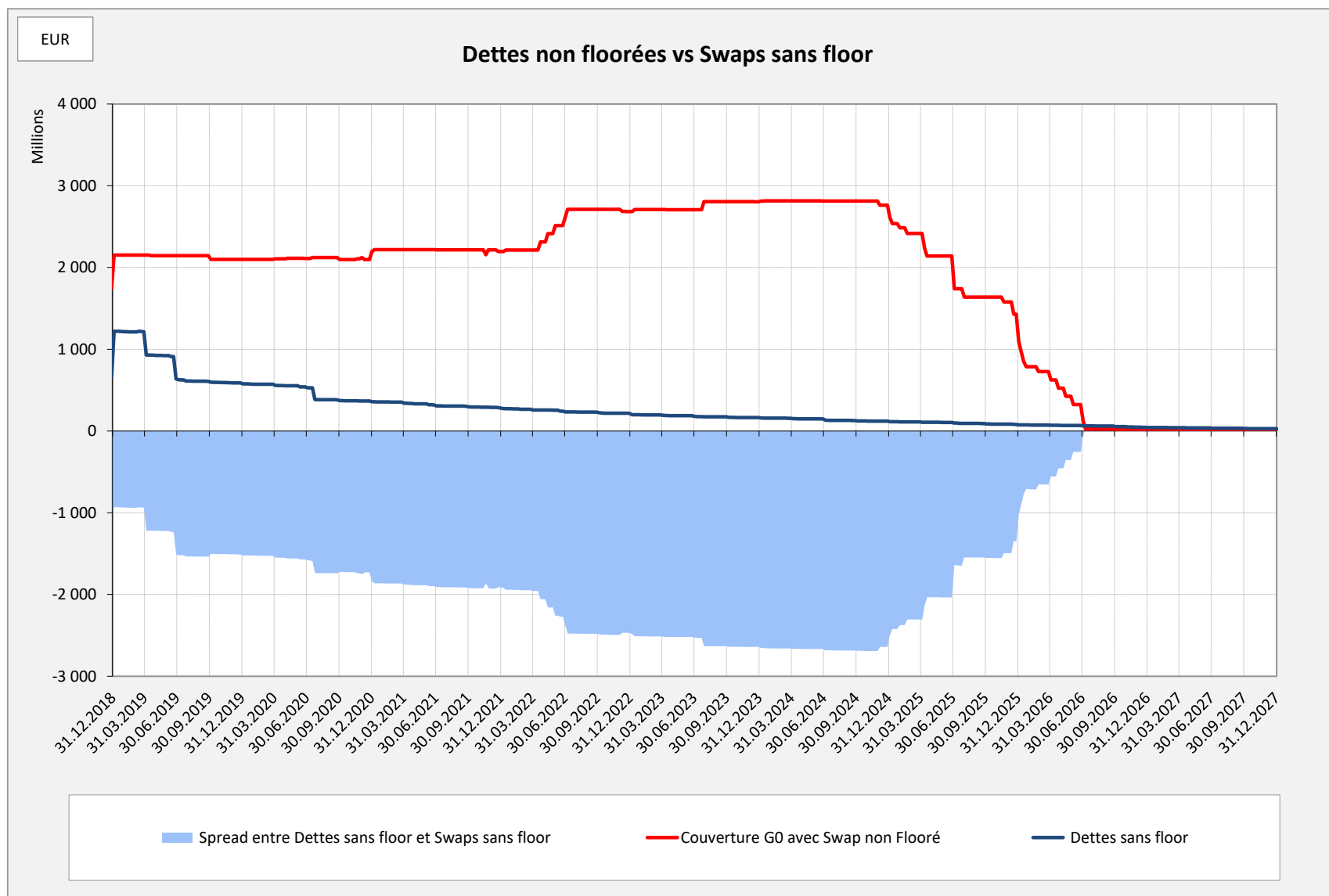
30 Juin 2021

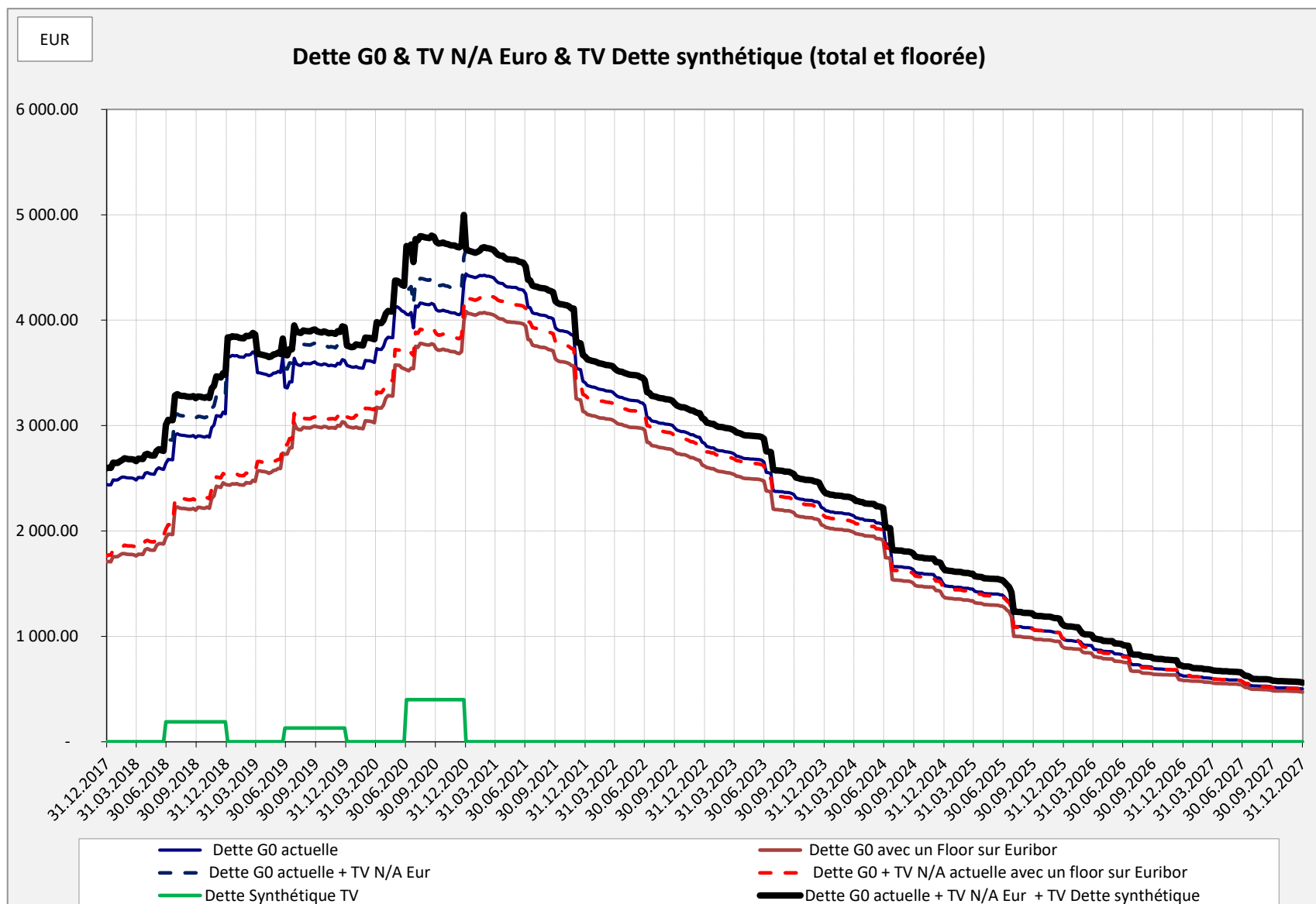


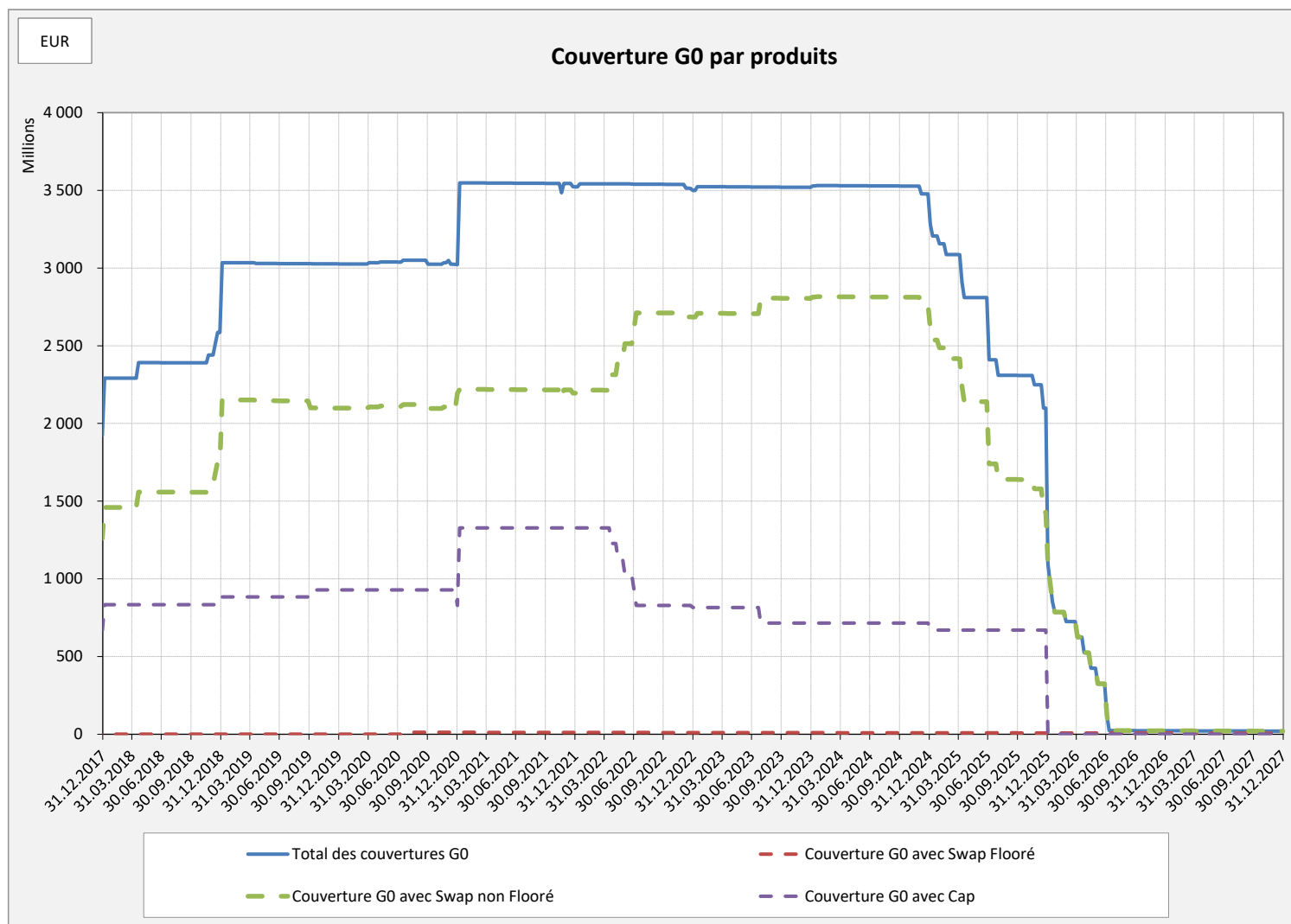


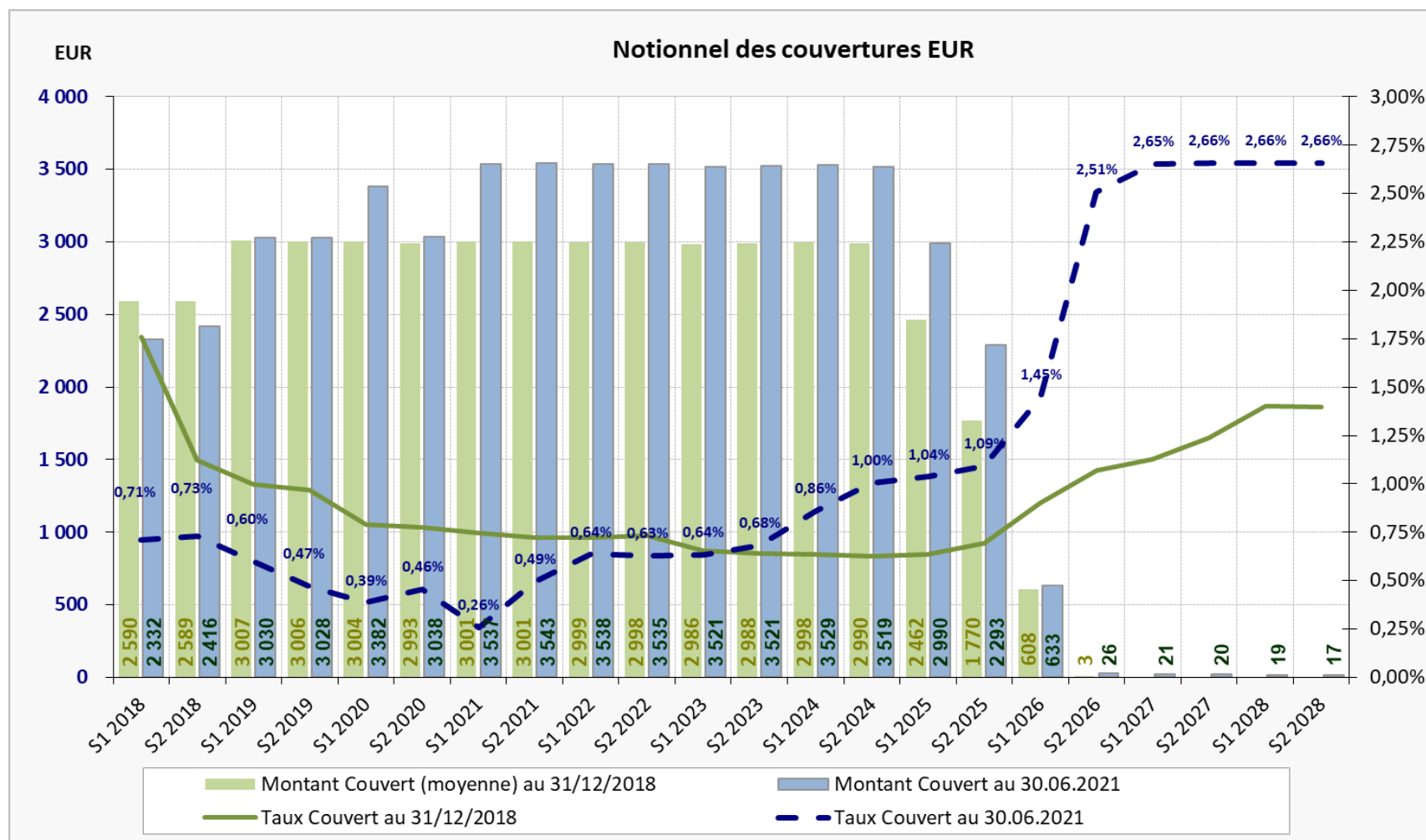


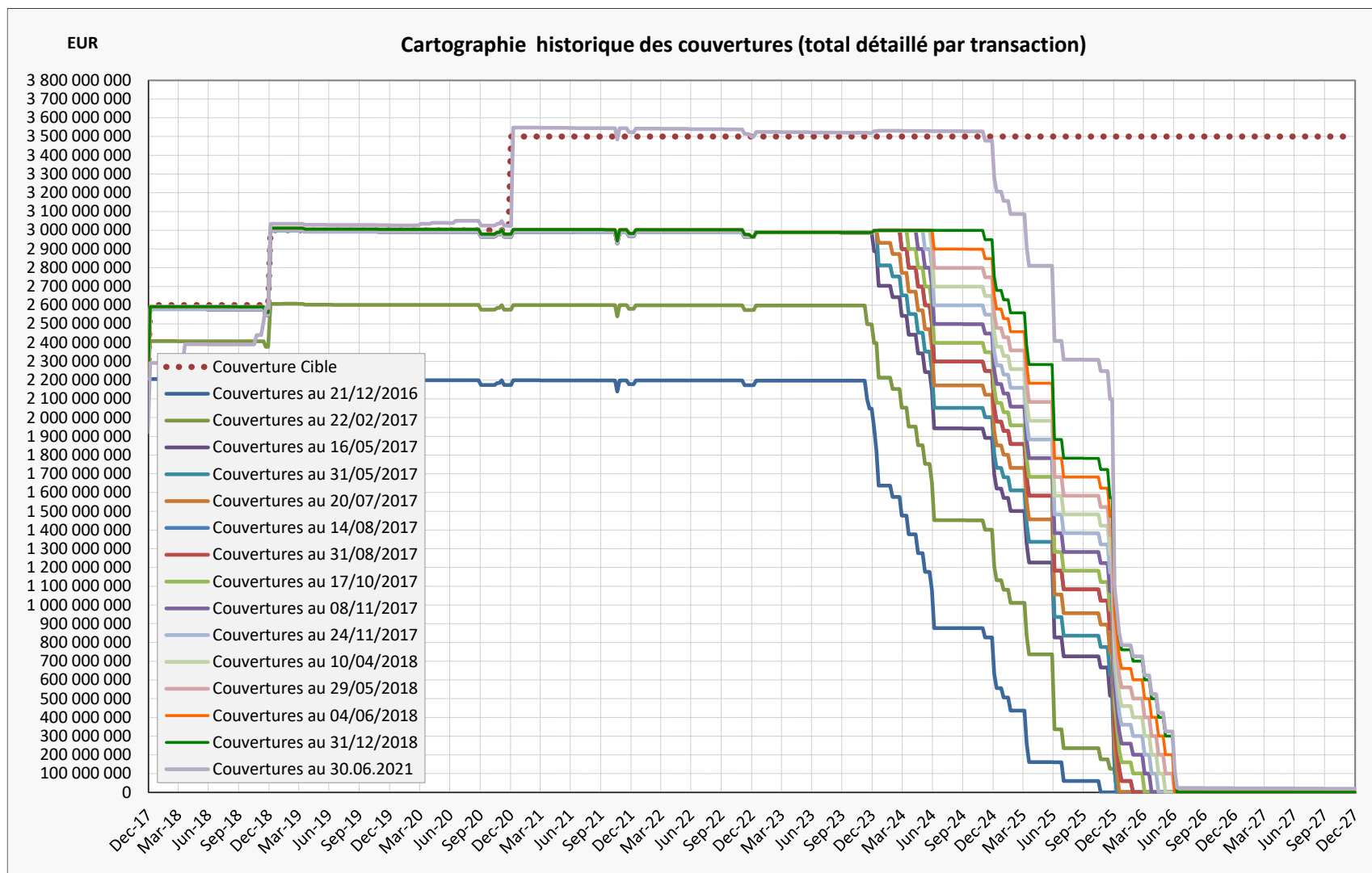




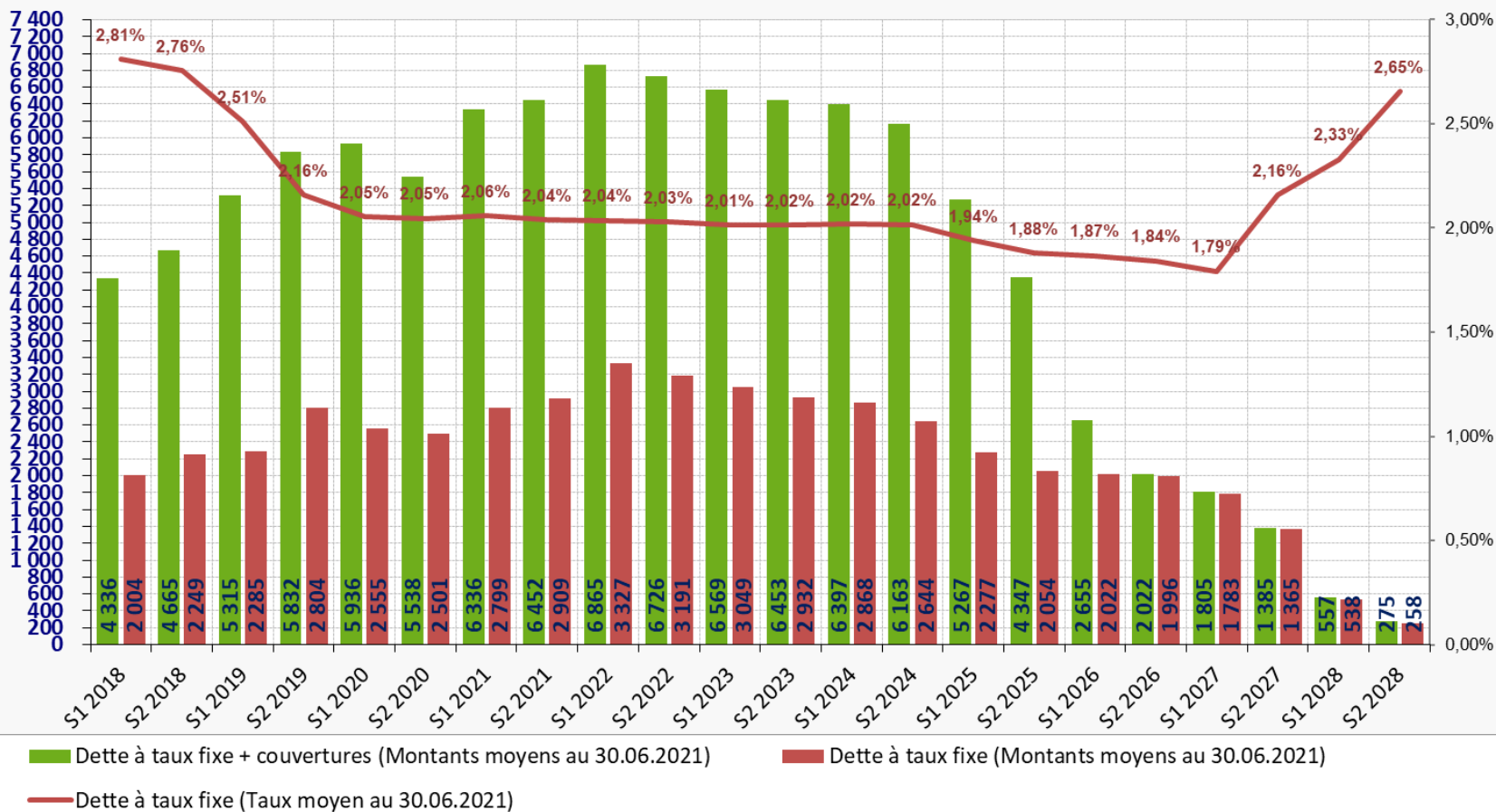






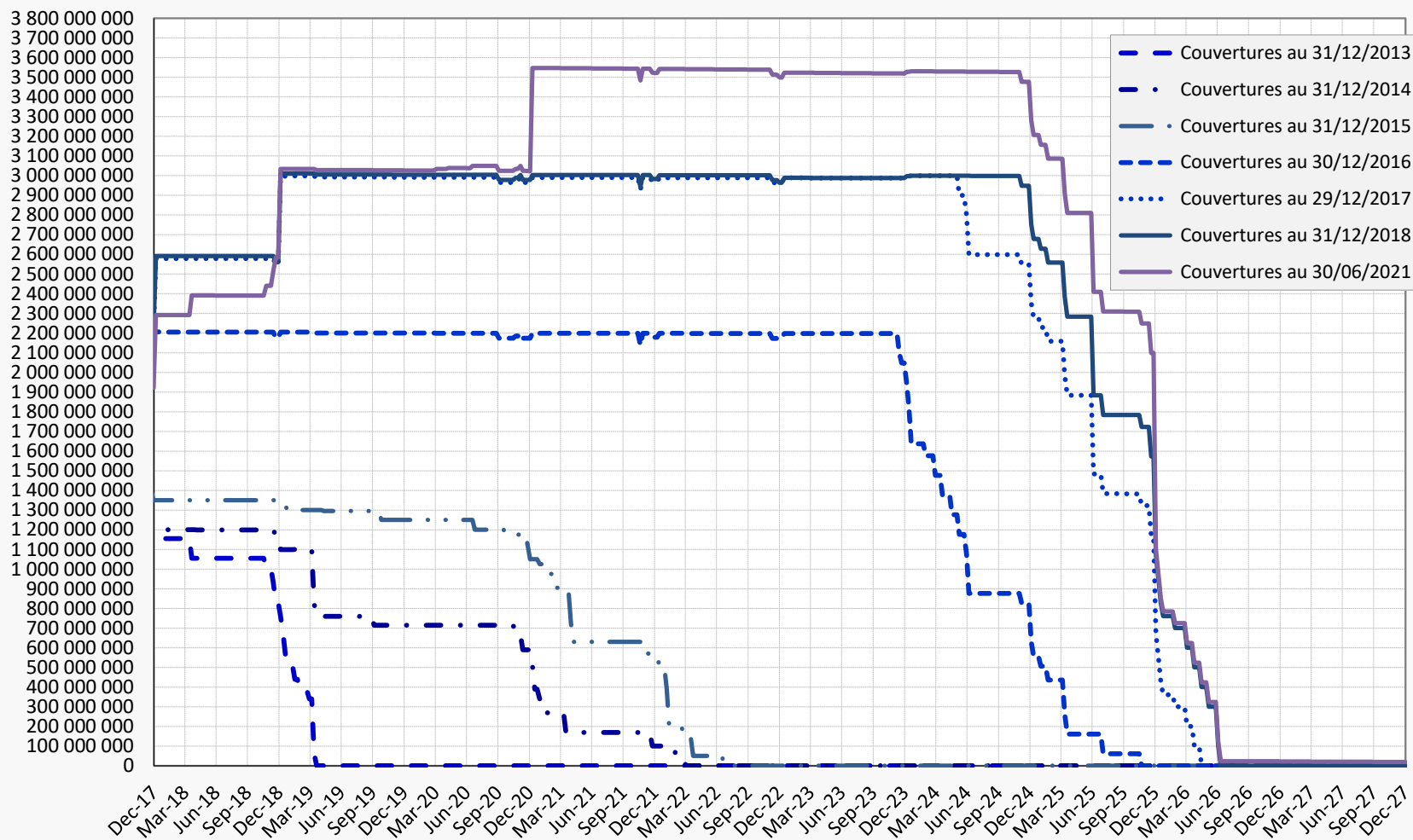


Dette "fixée" (dettes à taux fixe + couvertures dettes à taux variable)



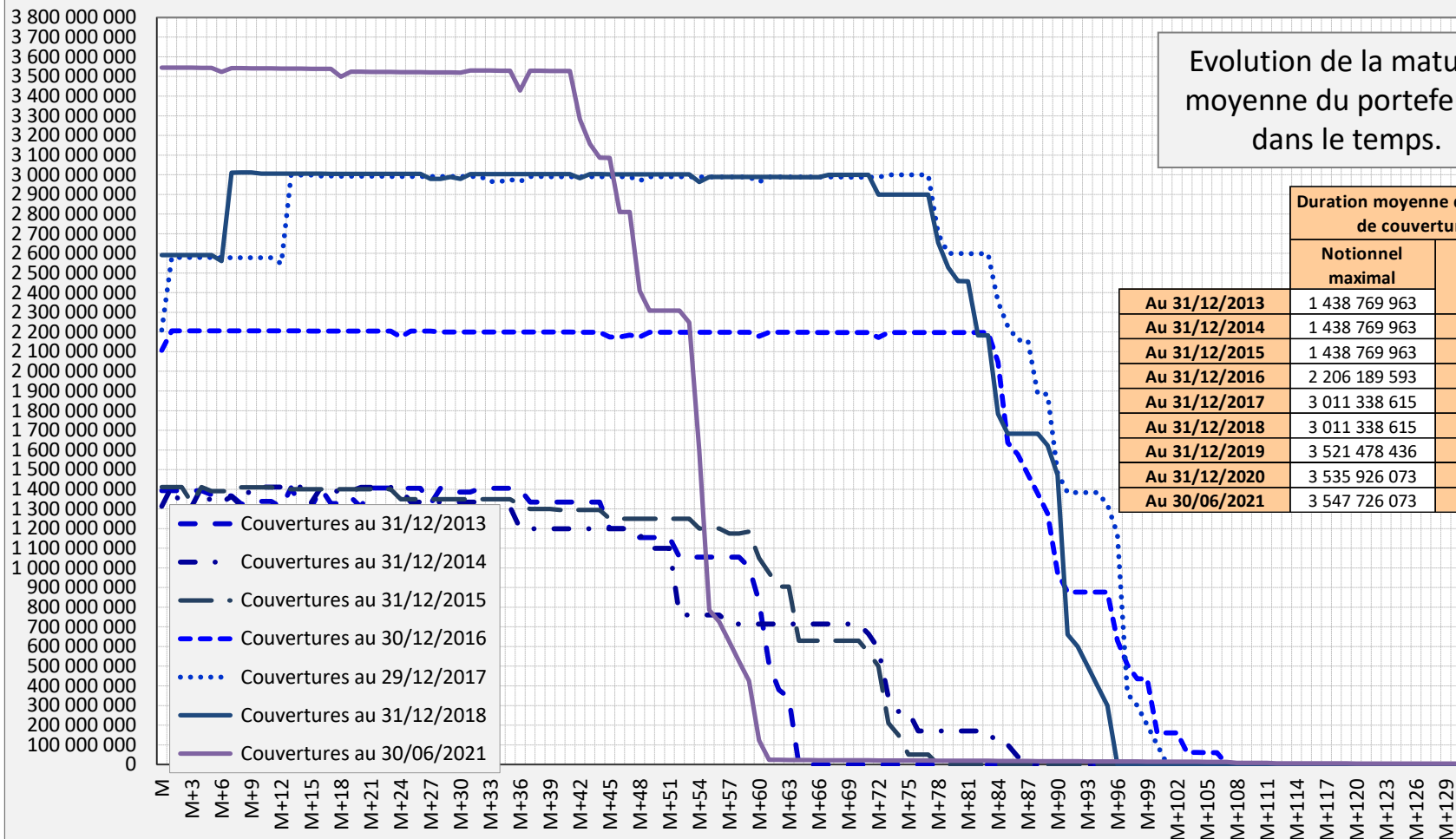
EUR

Cartographie historique des couvertures par date (total - synthèse vs clôtures)

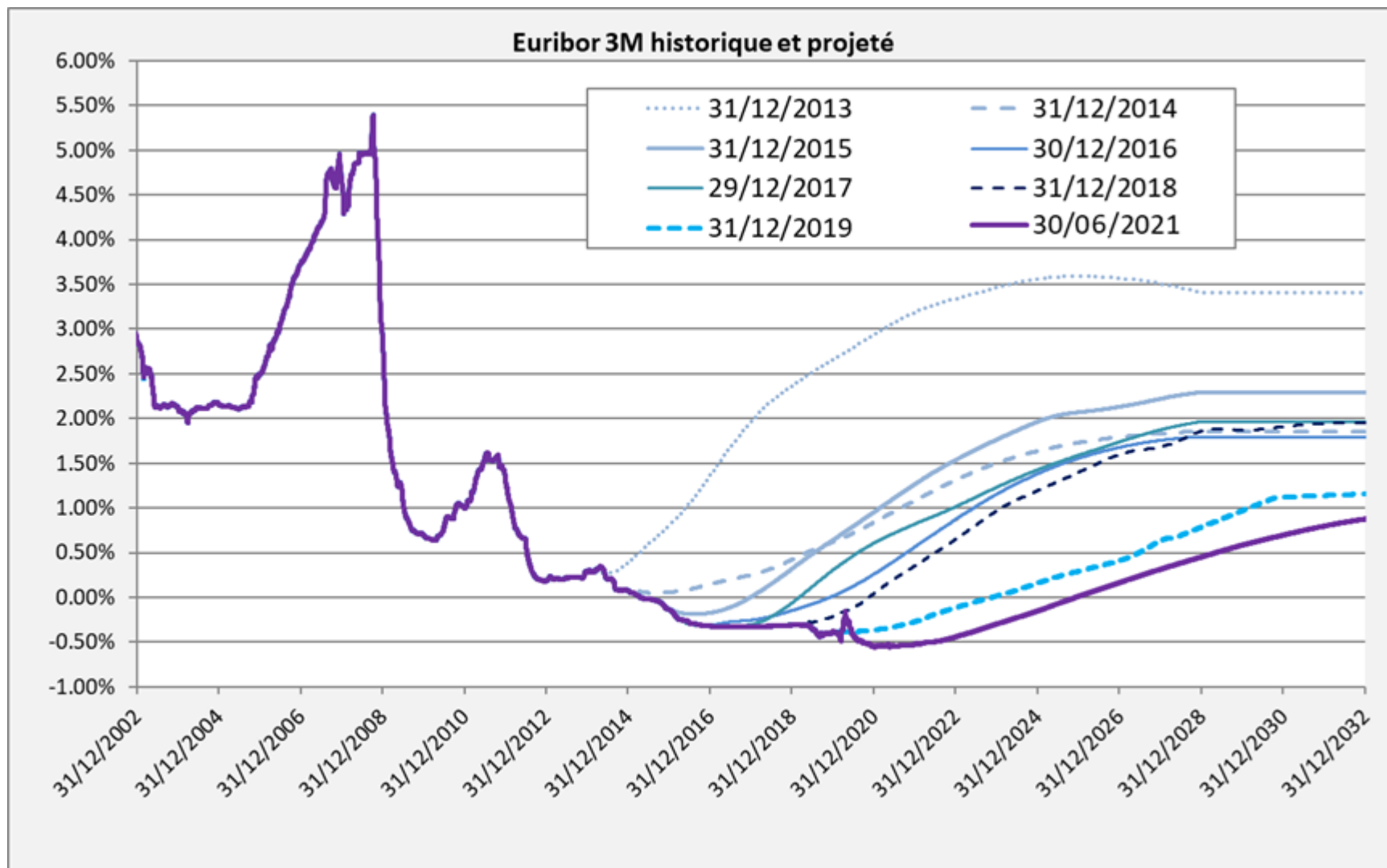


EUR

Cartographie des couvertures (EUR) - "Base glissante "



Annexes

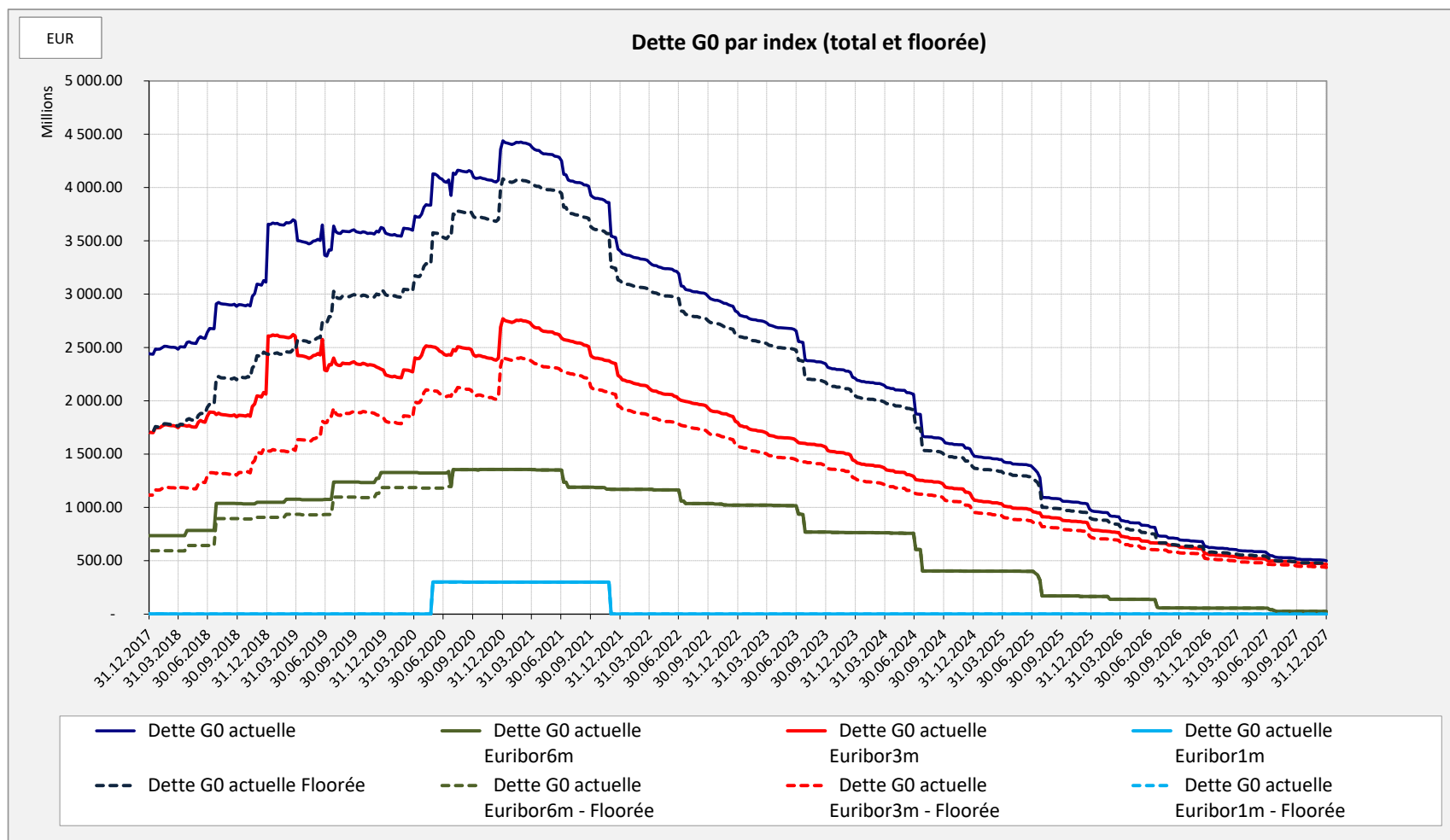


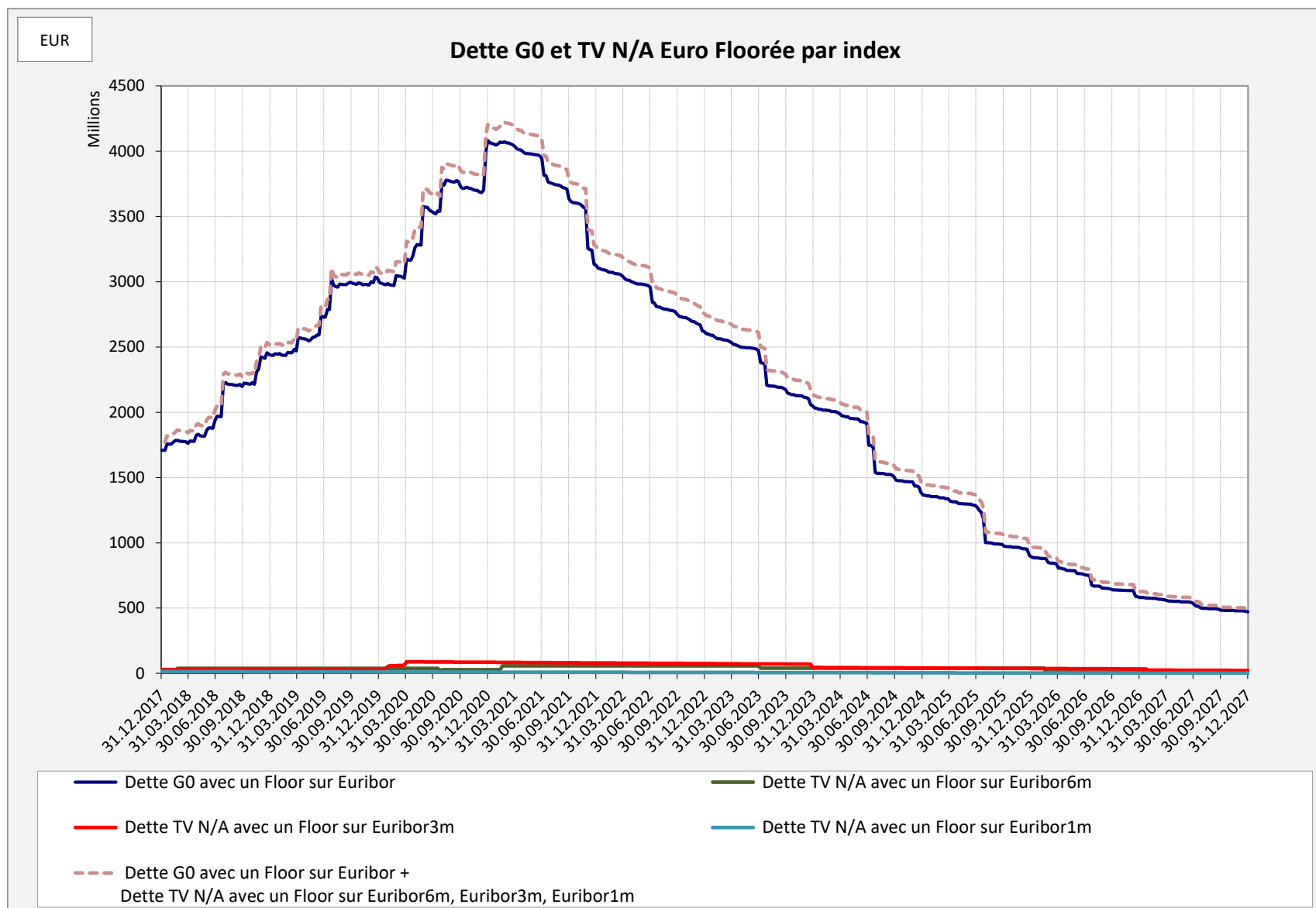
Données au 30 Juin 2021

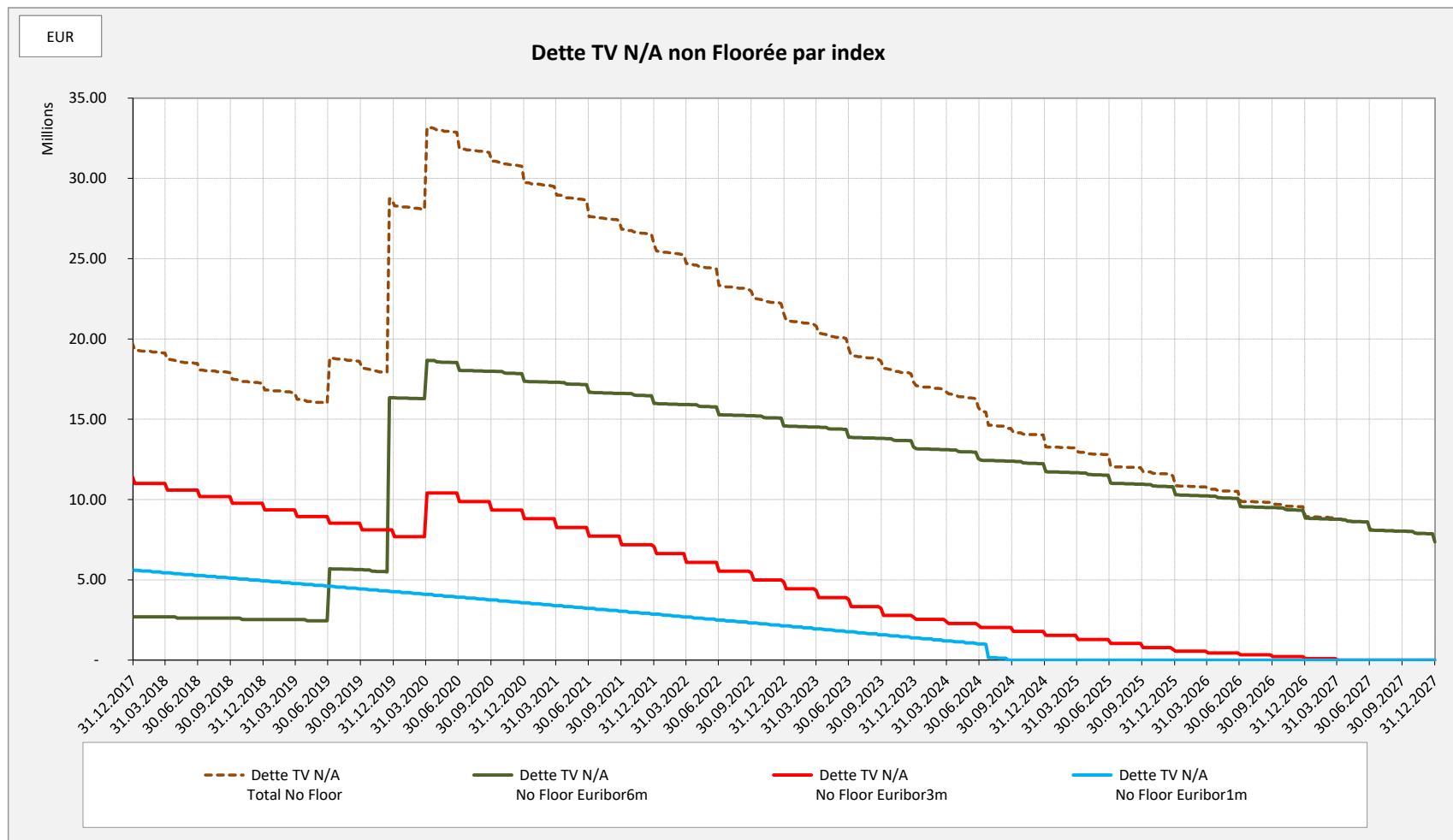
Détail de la dette TV N/A

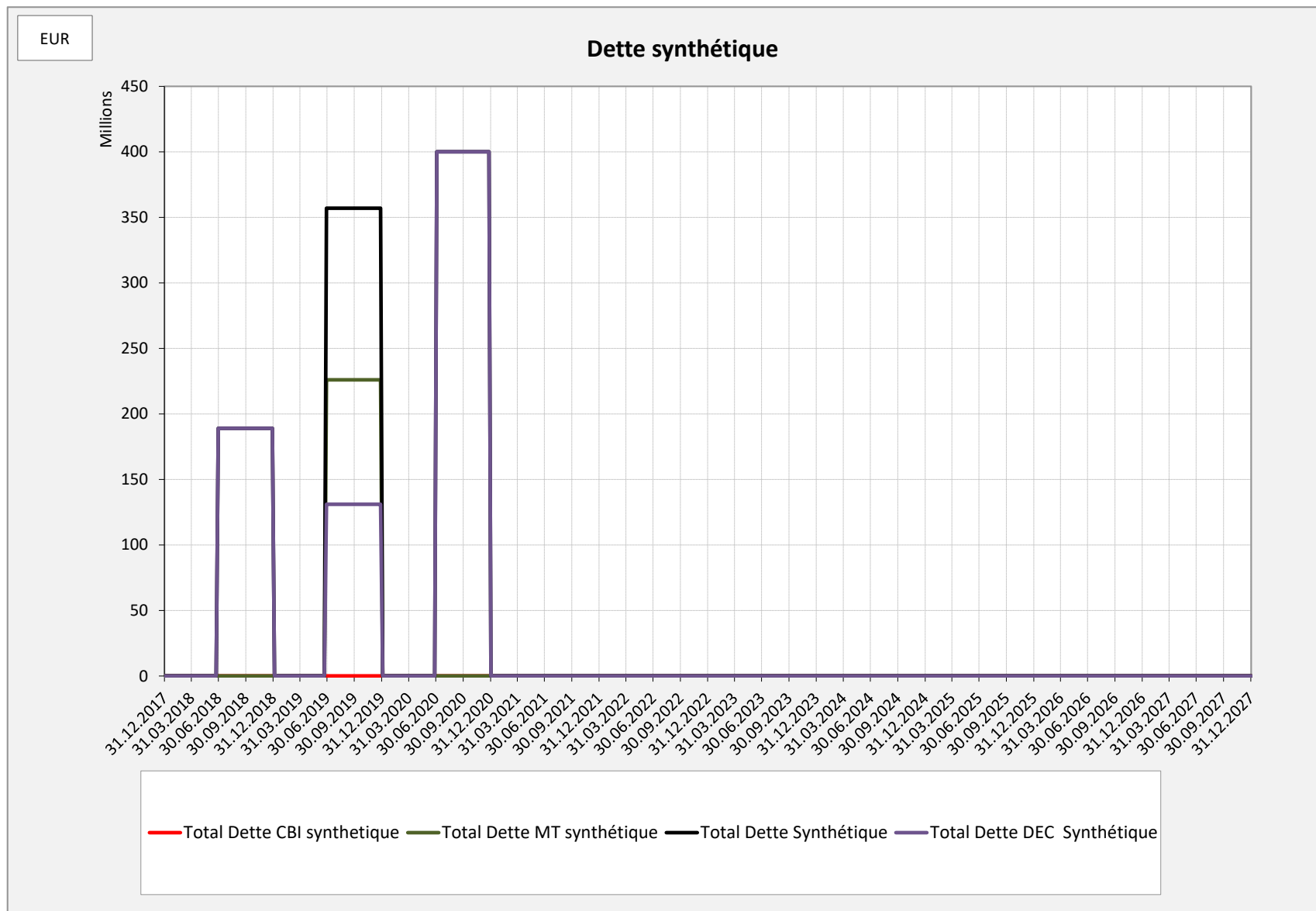
Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade Date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Payment Frequency	Currency	Amortizing	Rate	Floor	Initial notional
AUT52-F	Emprunt Standard 20 MCHF, Taux variable	CA Indosuez	18-Nov-20	23-Nov-20	18-Nov-25	END	3m	CHF	VRAI	Libor3MCHF	Floor	20 000 000.00
Total CHF												20 000 000.00
R05-F	SR KLAMOVKA S.R.O - Emprunt amortissable	RAIFFEISENBANK A.S	25-Mar-15	31-Dec-19	31-Dec-36	END	3m	CZK	VRAI	Pribor3m		94 000 000.00
SBER1-F	CZK sans floor	Sberbank	01-Apr-17	01-Apr-17	31-Jan-28	END	1m	CZK	VRAI	Pribor1m		49 915 343.00
SBER2-F	CZK avec floor	Sberbank	01-Apr-17	01-Apr-17	30-Sep-28	END	1m	CZK	VRAI	Pribor1m	Floor	69 780 364.79
SBER3-F	CZK sans floor	Sberbank	01-Apr-17	01-Apr-17	31-Jan-29	END	1m	CZK	VRAI	Pribor1m		60 100 000.00
SBER4-F	CZK avec floor	Sberbank	17-Apr-18	31-Dec-19	31-Dec-27	END	1m	CZK	VRAI	Pribor1m	Floor	67 600 000.00
SBER5-F	CZK avec floor	Sberbank	31-Dec-17	31-Dec-19	31-Dec-25	END	1m	CZK	VRAI	Pribor3m		135 999 058.76
SSD33-F	ORPEA SA - Emprunt remboursable in fine	SCHULDSCHEIN	20-Feb-19	26-Feb-19	26-Feb-24	END	3m	CZK	VRAI	Pribor3m	Floor	240 000 000.00
CESKO01-F	Emprunt Standard 95M CZK, Taux variable	Ceskonslovenska Obchodni Banka A.S	14-Aug-19	31-Dec-19	28-Sep-29	END	3m	CZK	VRAI	Pribor3m	Floor	95 010 200.00
R45-F	Emprunt Standard 60M CZK, Taux variable	Raiffeisen bank CZ	16-Dec-19	31-Mar-20	31-Dec-29	END	3m	CZK	VRAI	Pribor3m	Floor	60 000 000.00
R46-F	Emprunt Standard 639M CZK, Taux variable	Raiffeisen bank CZ	14-Aug-19	31-Dec-19	29-Dec-28	END	3m	CZK	VRAI	Pribor3m	Floor	639 000 000.00
CESKO02-F	Emprunt Standard 80M CZK, Taux variable	Ceskonslovenska Obchodni Banka A.S	14-Aug-19	31-Dec-19	28-Sep-29	END	3m	CZK	VRAI	Pribor3m	Floor	80 000 000.00
R47-F	Ligne de crédit 100ME, Taux variable	Raiffeisen bank CZ	08-Jul-19	08-Jul-19	03-Jun-22	END	1m	CZK	VRAI	Pribor1m	Floor	100 000 000.00
R52-F	Emprunt 5,4 MCZK, Taux variable	Raiffeisen bank CZ	03-Feb-21	12-Feb-21	31-Dec-30	END	3m	CZK	VRAI	Pribor3m		57 400 000.00
Total CZK												1 748 804 966.55
GENF6-F	CBI Campello 5.5ME Amort. Euribor 1m + 1.87%	GENEFIM	22-Jul-09	22-Jul-09	22-Jul-24	BEG	1m	EUR	VRAI	Euribor1m		5 467 319.87
GENF7-F	CBI Torrelozones 6.15ME Amort. Euribor 1m + 1.87%	GENEFIM	16-Jul-09	16-Jul-09	16-Jul-24	BEG	1m	EUR	VRAI	Euribor1m	Floor	6 113 330.10
FINA20-F	SCI RUE DE LONDRES	FINAMUR	28-Oct-08	14-Apr-16	28-Apr-23	END	3m	EUR	VRAI	Euribor3m	Floor	3 999 999.00
CMCIC14-F	Clinea SAS	CMCIC	01-Apr-16	01-Apr-16	23-Dec-25	END	3m	EUR	VRAI	Euribor3m		5 013 000.00
HSBC10-F	SCI LE VALLON	HSBC	18-Feb-05	01-Apr-16	01-Oct-23	END	3m	EUR	VRAI	Euribor3m		8 800 000.00
ARK3-F		ARKEA	30-Nov-15	01-Mar-17	05-Dec-22	END	3m	EUR	VRAI	Euribor3m	Floor	3 750 000.00
KBC12-F	Belgique	KBC	19-Apr-12	19-Apr-12	30-Jun-31	END	1m	EUR	VRAI	Euribor1m	Floor	11 750 000.00
R48-F	Emprunt Standard 5,4 MEUR, Taux variable	RLB Kaernten	01-Jun-16	01-Jun-16	30-Jun-37	END	1m	EUR	VRAI	Euribor3m	Floor	5 492 033.00
VOLKS2-F	Autriche	VOLKSBANK	30-Nov-17	31-Dec-17	05-Jan-43	END	3m	EUR	VRAI	Euribor3m	Floor	11 000 000.00
SSD18-F	ORPEA SA - Emprunt In fine	OBLIG	30-Jan-18	23-Feb-18	05-Jul-23	END	6m	EUR	VRAI	Euribor6m	Floor	18 000 000.00
LIBERBANK01-F	ORPEA SA - Emprunt amortissable	Liberbank	03-Jul-18	03-Jul-18	21-Apr-34	END	3m	EUR	VRAI	Euribor12m		7 385 784.00
BANKINT02-F	ORPEA SA - Emprunt amortissable	Bankinter	03-Jul-18	03-Jul-18	18-Mar-25	END	1m	EUR	VRAI	Euribor12m		4 705 059.65
GENF35-F	ORPEA SA - CBI	GENEFIM	18-Sep-09	18-Sep-09	08-Sep-24	END	1m	EUR	VRAI	Euribor1m		5 067 041.14
SPAR5-F	Emprunt Standard 2,78 MEUR, Taux variable	SPARKASSE	06-Oct-17	06-Oct-17	31-Oct-32	END	6m	EUR	VRAI	Euribor6m		2 778 925.03
ERB5-F	Emprunt Standard 7,14M EUR, Taux variable	ERSTE BANK	30-Jun-17	30-Jun-17	31-Dec-33	END	3m	EUR	VRAI	Euribor3m	Floor	7 145 130.57

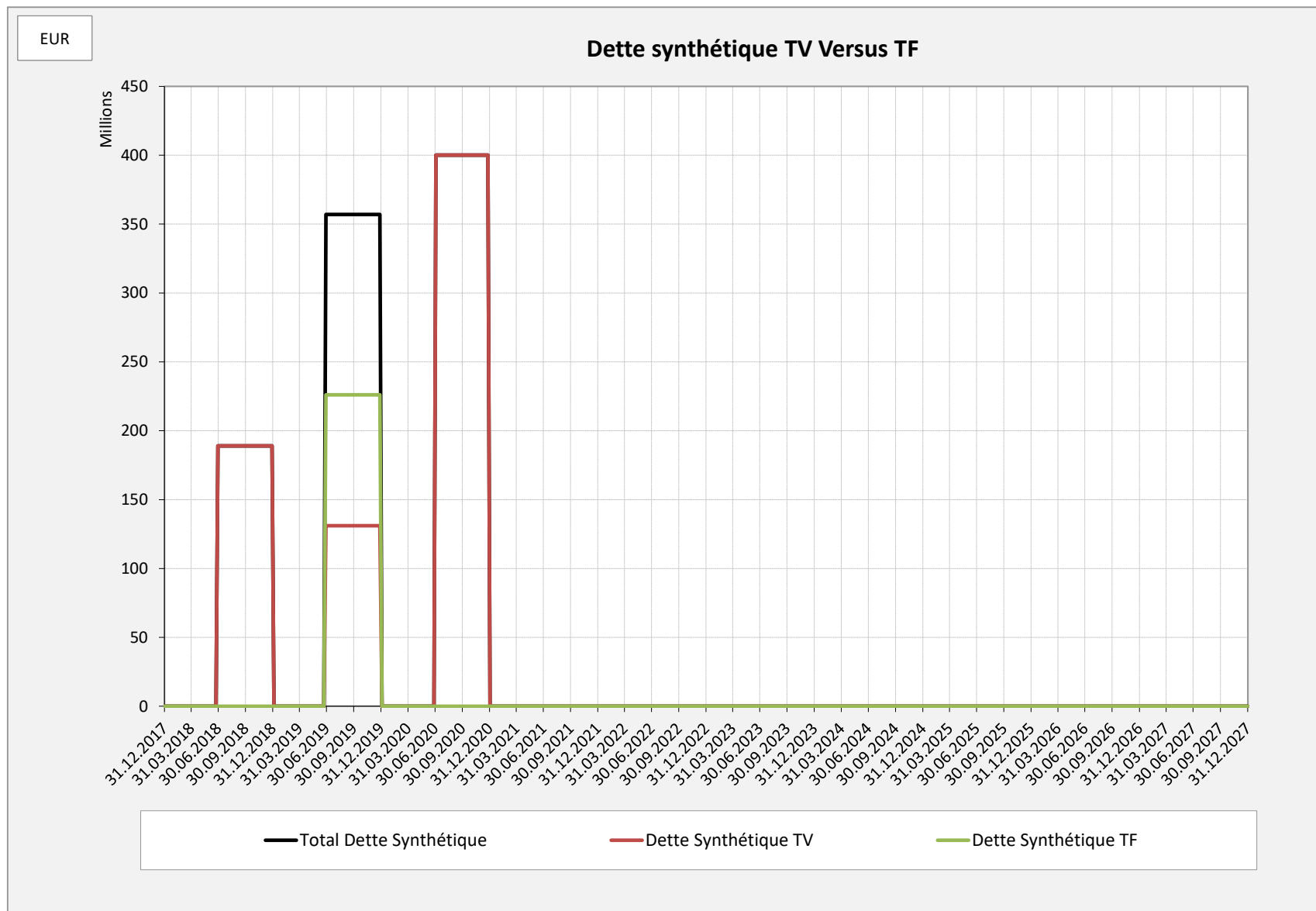
Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Tenor	Not CCY	Amortizing	Rate	Strike Rate	Floating Rate Margin	Initial Amount	Current Amount	Trade Type
CBI17-F	CBI, 22,6 M EUR, Taux fixe	Autres	27.12.2019	01.01.2020	01.01.2025	END	1m	EUR	VRAI		0.01254108		22 693 726.63	16 407 578.43	FIXED
Total FIXED													22 693 726.63	16 407 578.43	











Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade Date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Payment Frequency	Currency	Amortizing	Rate	Initial notional	Current Amount
CS1-F	SENEVITA AG - Emprunt amortissable	Crédit Suisse	01-Dec-16	16-Dec-16	31-Dec-22	END	3m	CHF	VRAI	1.6000%	12 500 000.00	5 000 000.00
CS7-F	SENEVITA AG - Emprunt amortissable	Crédit Suisse	01-Dec-16	16-Dec-16	31-Dec-21	END	3m	CHF	VRAI	1.7200%	12 500 000.00	12 500 000.00
VAL1-F	SENEVITA AG - Emprunt amortissable	VALIANT	31-Aug-16	31-Aug-16	31-Aug-31	END	3m	CHF	VRAI	1.3500%	8 000 000.00	7 100 000.00
BCF01-F	Emprunt 25MCHF Taux fixe 1.8%	BCF	11-Sep-17	22-Sep-17	30-Sep-37	END	3m	CHF	FAUX	1.8000%	25 000 000.00	23 775 000.00
VAL2-F	Emprunt 32MCHF Taux fixe 1.35%	Valiant	19-Jun-17	19-Jun-17	31-Dec-31	END	3m	CHF	FAUX	1.3500%	850 000.00	30 535 000.00
CS8-F	ORPEA SA - Emprunt amortissable	CS	01-Nov-18	01-Nov-18	30-Apr-24	END	3m	CHF	FAUX	2.1350%	9 000 000.00	4 500 000.00
R28-F	Emprunt 3,2MCHF Taux fixe 0,999380%	Raiffeisen	31-Dec-18	31-May-17	31-Dec-23	END	1m	CHF	FAUX	0.9994%	3 335 233.67	665 845.51
R29-F	Emprunt 1,8MCHF Taux fixe 1,28041%	Raiffeisen	01-Jun-18	01-Jul-18	01-Jun-23	END	1m	CHF	FAUX	1.2804%	1 855 685.01	773 615.76
R30-F	Emprunt 1,4MCHF Taux fixe 1,28041%	Raiffeisen Landesbank	25-Jan-05	25-Oct-05	30-Dec-22	END	3m	CHF	FAUX	0.7500%	1 408 957.01	1 408 957.01
R31-F	Emprunt 5,5MCHF Taux fixe 1,425%	Raiffeisen	18-Dec-18	01-Jan-19	31-Dec-24	END	3m	CHF	FAUX	1.4250%	8 550 000.00	8 050 000.00
R44-F	Emprunt Standard 1,01M CHF, Taux Fixe	Raiffeisen landesbank	25-Oct-05	29-Dec-05	01-Jan-23	END	3m	CHF	FAUX	0.7500%	1 018 374.27	1 018 374.27
BCGE1-F	Emprunt 19,4 MCHF, Taux fixe	BCGE	25-Nov-20	15-Jan-21	30-Sep-00	END	3m	CHF	FAUX	1.1000%	19 400 000.00	19 400 000.00
Total CHF											103 418 249.96	114 726 792.55
CEK2-F	CZK	CeskaSporitelna	01-Apr-17	01-Apr-17	30-Jun-33	END	1m	CZK	VRAI	2.6400%	35 428 471.00	28 588 717.00
Total CZK											35 428 471.00	28 588 717.00
FORT11-F	Emprunt 3,055MEUR Taux fixe 1,8535%	LEASECOM	02-Dec-04	31-Dec-09	31-Dec-21	END	1m	EUR	FAUX	0.1856%	3 055 762.81	147 603.32
DB4-F	Note 90ME Taux Fixe 5.25%	DB	04-Dec-12	04-Dec-12	04-Dec-26	END	1y	EUR	FAUX	5.2500%	90 000 000.00	90 000 000.00
FRUCT11-F	Crédit-bail Livry Gargan 1.08ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-Jan-11	01-Jan-11	01-Jan-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	1 082 542.03	742 670.53
FRUCT11-F	Crédit-bail Livry Gargan 7.30ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-Jan-11	01-Jan-11	01-Jan-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	7 295 994.68	5 005 364.34
FRUCT11-F	Crédit-bail Livry Gargan 3.92ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-Jan-11	01-Jan-11	01-Jan-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	3 917 120.75	2 687 312.52
FRUCT11-F	Crédit-bail Livry Gargan 7.30ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-Jan-11	01-Jan-11	01-Jan-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	7 295 994.68	5 005 364.34
FRUCT11-F	Crédit-bail Livry Gargan 1.70ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-Jan-11	01-Jan-11	01-Jan-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	1 704 342.55	1 169 251.83
CFF2-F	Emprunt 3,5ME 3,04%	CFF	30-Mar-13	30-Mar-13	30-Mar-45	END	3m	EUR	VRAI	1.8200%	3 500 000.00	3 007 448.73
SSD1-F	SSD Schuldschein Geme Tranche 8ME 7y FIX	OBLIG	21-Jul-14	25-Jul-14	27-Jul-21	END	1y	EUR	FAUX	3.3270%	8 000 000.00	8 000 000.00
SSD1-F	SSD Schuldschein 7eme Tranche 6,5ME 10y FIX	OBLIG	21-Jul-14	25-Jul-14	25-Jul-24	END	1y	EUR	FAUX	4.1480%	6 500 000.00	6 500 000.00
EUROPP1-F	Euro PP 7y FIX	OBLIG	24-Jul-14	31-Jul-14	31-Jul-21	END	1y	EUR	FAUX	3.3270%	52 000 000.00	52 000 000.00
SSD2-F	SSD Schuldschein 8y 40M FIX	OBLIG	10-Apr-15	17-Apr-15	17-Apr-23	END	1y	EUR	FAUX	2.5090%	40 000 000.00	40 000 000.00
SSD3-F	SSD Schuldschein 4eme Tranche 25ME 6y FIX	OBLIG	14-Jul-15	21-Jul-15	21-Jul-21	END	1y	EUR	FAUX	2.4800%	25 000 000.00	25 000 000.00
SSD3-F	SSD Schuldschein Geme Tranche 67,5ME 7y FIX	OBLIG	14-Jul-15	21-Jul-15	21-Jul-22	END	1y	EUR	FAUX	2.7890%	67 500 000.00	67 500 000.00
BLB01-F	Emprunt 9,21ME Taux Fixe 2,15%	Bremer Landesbank	29-May-15	31-May-15	31-May-25	END	1m	EUR	FAUX	2.1500%	9 210 000.00	6 369 526.91
BLB02-F	Emprunt 12,79ME Taux Fixe 2,55%	Bremer Landesbank	29-May-15	31-May-15	31-May-25	END	1m	EUR	FAUX	2.5500%	12 790 000.00	8 964 869.83
CAIB14-F	Emprunt 20ME Taux Fixe 2,568%	CACIB	17-Dec-15	22-Dec-15	22-Dec-22	END	1y	EUR	FAUX	2.5680%	20 000 000.00	20 000 000.00
CAIB15-F	Emprunt 6ME Taux Fixe 3,144%	CACIB	17-Dec-15	22-Dec-15	22-Dec-25	END	1y	EUR	FAUX	3.1440%	6 000 000.00	6 000 000.00
BEL01-F	Emprunt 50ME Taux Fixe 2,506%	BELFIUS Bank&Insurance	11-Dec-15	22-Dec-15	22-Dec-22	END	1y	EUR	FAUX	2.5060%	50 000 000.00	50 000 000.00
CECA1-F	ORPEA SA - Emprunt amortissable	CECA	26-Apr-16	30-May-16	30-May-23	END	1m	EUR	VRAI	2.1000%	20 000 000.00	5 476 190.48
SSD4-F	SSD Schuldschein 2eme Tranche 20ME 5y FIX	OBLIG	05-Jul-16	05-Jul-16	05-Jul-21	END	1y	EUR	FAUX	1.5000%	20 000 000.00	20 000 000.00
SSD4-F	SSD Schuldschein 4eme Tranche 10ME 6y FIX	OBLIG	05-Jul-16	05-Jul-16	05-Jul-22	END	1y	EUR	FAUX	1.6000%	10 000 000.00	10 000 000.00
SSD4-F	SSD Schuldschein Geme Tranche 20ME 7y FIX	OBLIG	05-Jul-16	05-Jul-16	05-Jul-23	END	1y	EUR	FAUX	1.7790%	20 000 000.00	20 000 000.00
BBVA1-F	Espagne - Emprunt amortissable	BBVA	28-Jun-16	28-Jun-16	28-Jun-26	END	1m	EUR	VRAI	1.7500%	4 500 000.00	2 250 000.00
BBVA2-F	Espagne - Emprunt amortissable	BBVA	28-Jun-16	28-Jun-16	28-Jun-26	END	1m	EUR	VRAI	1.7500%	4 500 000.00	2 250 000.00
NATX10-F	Espagne - Emprunt amortissable	NATIXIS	27-May-16	27-May-16	27-May-30	END	3m	EUR	VRAI	1.4000%	9 360 000.00	6 836 053.83
KBC8-F	Belgique - CBM	KBC	07-Jun-16	07-Jun-16	07-May-23	END	1m	EUR	VRAI	1.5500%	1 803 532.00	504 781.23
BEL02-F	Belgique - CBM	BELFIUS Lease	20-May-16	20-May-16	20-May-23	END	1m	EUR	VRAI	1.3300%	984 596.00	274 098.92
BEL03-F	Belgique - CBM	BELFIUS Lease	20-May-16	20-May-16	20-May-23	END	1m	EUR	VRAI	1.3300%	1 232 578.30	343 137.02
CECA1-F	ORPEA SA - Emprunt amortissable	CAISSE D'EP	01-Sep-16	21-Sep-16	30-Sep-22	END	3m	EUR	VRAI	1.0500%	10 000 000.00	2 083 333.27
SSD6-F	SSD Schuldschein 1ere Tranche 15ME 5y FIX	OBLIG	09-Nov-16	18-Nov-16	18-Nov-21	END	6m	EUR	FAUX	1.5200%	15 000 000.00	15 000 000.00

Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade Date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Payment Frequency	Currency	Amortizing	Rate	Initial notional	Current Amount
SSD6-F	SSD Schuldschein 4eme Tranche 12ME 7y FIX	OBLIG	09-Nov-16	18-Nov-16	18-Nov-23	END	6m	EUR	FAUX	1.9170%	12 000 000.00	12 000 000.00
SOGE15-F	ORPEA SA - Emprunt amortissable	SOCGEN	17-Oct-16	07-Nov-16	07-Nov-21	END	3m	EUR	VRAI	1.1950%	30 000 000.00	30 000 000.00
BBVA4-F	GRUPO CARE - Emprunt amortissable	BBVA	30-Dec-16	30-Dec-16	30-Dec-31	END	3m	EUR	VRAI	1.8000%	37 880 000.00	27 607 551.24
SOGE16-F	ORPEA SA - Emprunt amortissable	SOCGEN	02-Mar-17	29-Mar-17	29-Mar-22	END	3m	EUR	VRAI	1.4800%	40 000 000.00	6 000 000.00
NATX12-F	ORPEA SA - Emprunt obligataire	NATIXIS	02-Mar-17	06-Mar-17	06-Mar-25	END	12m	EUR	VRAI	2.3000%	50 000 000.00	50 000 000.00
GMBH1-F	PSYCHOSOMATISCHE FACHKLINIK GENGEBACH GMBH - CBM	HW LEASING GMBH	30-Aug-16	01-Sep-16	01-Sep-21	END	1m	EUR	VRAI	4.1883%	499 501.04	18 393.34
SGL1-F	CLINEA SAS - CBM	SOGELEASE	22-Dec-16	31-Dec-16	31-Dec-21	END	3m	EUR	VRAI	0.7004%	325 131.41	19 614.24
SGL2-F	ORPEA SA - CBM	SOGELEASE	22-Dec-16	31-Dec-16	31-Dec-21	END	3m	EUR	VRAI	0.7006%	1 165 363.38	70 303.18
BBVA4-F	Espagne - Emprunt amortissable	BBVA	27-May-17	27-May-17	27-May-32	END	1m	EUR	VRAI	1.8000%	21 556 000.00	16 251 609.34
IMPULS1-F	Autriche CBM 24	Impuls Leasing	26-Apr-17	01-May-17	01-May-25	END	1m	EUR	VRAI	2.6500%	250 458.65	128 049.67
SANTO1-F	Espagne - Emprunt amortissable	SANTANDER	27-Feb-17	27-Feb-17	27-Feb-29	END	3m	EUR	VRAI	1.4900%	7 616 670.24	4 919 099.53
CIC25-F	SCI FRANCOIS RABELAIS	CIC NORD OUEST	30-Jan-12	01-Mar-17	20-Jan-24	END	1m	EUR	VRAI	4.6000%	170 500.00	45 017.16
CIC26-F	SCI FRANCOIS RABELAIS	CIC NORD OUEST	27-Jan-12	01-Mar-17	20-Jan-24	END	1m	EUR	VRAI	4.6000%	169 500.00	46 111.10
CECA3-F	CLINEA SAS - Siège	CECA	04-Jul-17	04-Jul-17	04-Jul-24	END	1m	EUR	VRAI	2.4000%	5 000 000.00	2 306 073.67
SSD8-F	ORPEA SA - Siège	OBLIG	30-Jun-17	05-Jul-17	05-Jul-22	END	12m	EUR	VRAI	1.5950%	20 000 000.00	20 000 000.00
SSD12-F	ORPEA SA - Siège	OBLIG	30-Jun-17	05-Jul-17	05-Jul-27	END	12m	EUR	VRAI	2.7930%	20 000 000.00	20 000 000.00
CECA4-F	CLINEA SAS - Siège	CECA	30-May-17	06-Aug-17	06-Aug-24	END	1m	EUR	VRAI	2.4000%	20 000 000.00	9 464 259.14
BTAR02-F	ORPEA SA - Siège	BTAR	29-Aug-17	20-Sep-17	20-Sep-22	END	3m	EUR	VRAI	1.0500%	5 000 000.00	1 274 683.39
SSD13-F	SSD	OBLIG	20-Jun-17	03-Jul-17	03-Jul-24	END	12m	EUR	VRAI	2.1300%	150 000 000.00	150 000 000.00
SSD15-F	SGI_000001	OBLIG	08-Mar-16	22-Dec-16	22-Dec-25	END	12m	EUR	VRAI	3.1440%	13 000 000.00	13 000 000.00
TRIO2-F	Belgique	TRIODOS	27-Mar-14	08-Nov-16	01-Nov-36	END	3m	EUR	VRAI	2.1560%	12 150 000.00	9 852 712.01
NATX13-F	CBM-ORPEA SA - Siège	NATIXIS	01-Jul-17	01-Jul-17	01-Jul-22	END	1m	EUR	VRAI	1.6938%	15 563 298.27	3 484 701.31
BBVA5-F	Espagne	BBVA	20-May-15	20-May-15	20-Jun-25	END	1m	EUR	VRAI	2.0379%	5 745 785.67	2 421 366.59
BBVA6-F	Regroupé 1228;1229;1230	BBVA	30-Sep-17	30-Sep-17	30-Sep-32	END	1m	EUR	VRAI	1.8000%	16 442 000.00	12 737 571.34
SSD17-F	ORPEA SA Holding	OBLIG	15-Dec-17	15-Dec-17	15-Dec-24	END	12m	EUR	VRAI	2.2000%	63 000 000.00	63 000 000.00
OBLIG1-F	OBLIG - BNP-HSBC-SG-CACIB	OBLIG	06-Mar-18	10-Mar-18	10-Mar-25	END	1y	EUR	FAUX	2.6250%	400 000 000.00	400 000 000.00
CADEP12-F	ORPEA SA - Emprunt amortissable	CAISSE D'EP	03-Jan-18	15-Jan-18	05-Feb-24	END	3m	EUR	FAUX	1.4000%	10 000 000.00	4 687 528.20
BBVA9-F	Espagne - Emprunt amortissable	BBVA	22-Dec-17	22-Dec-17	22-Dec-32	END	1m	EUR	FAUX	1.8000%	4 854 000.00	3 835 605.36
BBVA10-F	Espagne - Emprunt amortissable	BBVA	22-Dec-17	22-Dec-17	22-Dec-32	END	1m	EUR	FAUX	1.8000%	4 269 000.00	3 373 341.33
BBVA11-F	Espagne - Emprunt amortissable	BBVA	22-Dec-17	22-Dec-17	22-Dec-32	END	1m	EUR	FAUX	1.8000%	3 297 000.00	2 605 271.99
BBVA12-F	Espagne - Emprunt amortissable	BBVA	25-Jan-18	25-Jan-18	25-Dec-24	END	1m	EUR	FAUX	1.8000%	4 319 000.00	2 252 633.93
TRIO1-F	ORPEA SA - Emprunt amortissable	TRIODOS	28-Jun-18	28-Jun-18	01-Apr-39	END	3m	EUR	FAUX	2.2900%	10 000 000.00	9 192 732.89
BNP44-F	ORPEA SA - Emprunt amortissable	BNP Fortis	05-Jun-18	16-Jun-18	16-Jun-23	END	1m	EUR	FAUX	1.0800%	1 800 000.00	731 842.26
SSD26-F	Emprunt 10ME Taux fixe 1,9% In Fine	SCHULDSCHIEIN	20-Jul-18	25-Jul-18	25-Jul-24	END	12M	EUR	FAUX	1.9000%	10 000 000.00	10 000 000.00
SSD28-F	Emprunt 35ME Taux fixe 2,229% In Fine	SCHULDSCHIEIN	20-Jul-18	25-Jul-18	25-Jul-25	END	12M	EUR	FAUX	2.2290%	35 000 000.00	35 000 000.00
SSD29-F	Emprunt 37.5ME Taux fixe 1,633% In Fine	SCHULDSCHIEIN	20-Jul-18	25-Jul-18	25-Jul-23	END	12M	EUR	FAUX	1.6330%	37 500 000.00	37 500 000.00
BTAR02-F	Emprunt 8ME Taux fixe 1,15%	Banque Tarneaud	24-Sep-18	01-Oct-18	01-Oct-23	END	3m	EUR	FAUX	1.1500%	8 000 000.00	4 057 413.55
BPI11-F	Emprunt 10ME Taux fixe 0,55%	BPI France	07-Nov-18	15-Nov-18	30-Nov-23	END	3m	EUR	FAUX	0.5500%	8 000 000.00	5 034 350.84
CS6-F	Emprunt 8.5ME Taux fixe 1,75%	Credit Suisse	04-Oct-18	01-Nov-18	31-Dec-28	END	3m	EUR	FAUX	1.7500%	8 500 000.00	5 000 000.00
BPIPORT01-F	Emprunt 2.38ME Taux fixe 2%	BPI Portugal	17-Oct-18	17-Oct-18	05-Jan-30	END	1m	EUR	FAUX	2.0000%	2 387 463.59	1 875 210.22
SSD31-F	ORPEA SA - Emprunt remboursable in fine	SCHULDSCHIEIN	13-Feb-19	26-Feb-19	26-Feb-24	END	12m	EUR	FAUX	1.5280%	25 000 000.00	25 000 000.00
NATX15-F	Emprunt 27MEUR Taux fixe 1,3485%	NATIXIS	28-Dec-18	01-Jan-19	01-Jan-24	END	1m	EUR	FAUX	1.3485%	27 185 277.15	14 274 612.31
BP04-F	Emprunt 23MEUR Taux fixe 1,5978%	Banque Postale	01-Jan-18	01-Feb-18	01-Jan-23	END	1m	EUR	FAUX	1.5978%	22 320 533.18	6 996 585.11
CB1-F	Emprunt 18MEUR Taux fixe 2,215018%	Autre	12-Feb-16	01-Dec-16	01-Nov-36	END	1m	EUR	FAUX	2.2150%	18 110 068.89	15 356 056.43
NATX16-F	Emprunt 17MEUR Taux fixe 1,659558%	NATIXIS	20-Dec-17	20-Jan-18	20-Dec-22	END	1m	EUR	FAUX	1.6596%	17 158 634.65	5 383 925.50
NATX17-F	Emprunt 14MEUR Taux fixe 1,659564%	NATIXIS	01-Jul-18	01-Aug-18	01-Jul-23	END	1m	EUR	FAUX	1.6596%	14 758 163.16	6 400 672.40
CB12-F	Emprunt 14MEUR Taux fixe 2,0000%	Autre	01-Jul-18	01-Jul-18	28-Feb-79	END	3m	EUR	FAUX	2.0000%	12 570 004.83	12 532 425.37
CB13-F	Emprunt 14MEUR Taux fixe 1,9967%	Autre	01-Jan-12	01-Jun-15	01-Jan-32	END	1m	EUR	FAUX	1.9967%	14 250 524.80	10 306 672.15
R22-F	Emprunt 9MEUR Taux fixe 2,4948%	Raiffeisen	01-Jul-09	01-Sep-15	01-Jul-29	END	1m	EUR	FAUX	2.4948%	9 495 992.26	7 551 580.58
ALB1-F	Emprunt 8MEUR Taux fixe 2,50031%	Alba Leasing	30-Jun-17	01-Jul-17	31-Dec-31	END	1m	EUR	FAUX	2.5003%	8 562 425.33	6 839 427.58

Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade Date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Payment Frequency	Currency	Amortizing	Rate	Initial notional	Current Amount
R23-F	Emprunt 6MEUR Taux fixe 1,897%	Raiffeisen	01-Feb-16	01-Mar-16	01-Oct-27	END	1m	EUR	FAUX	1.8970%	6 356 004.39	5 011 200.38
UBI1-F	Emprunt 6MEUR Taux fixe 4,5133%	UBI Leasing	01-Jun-17	15-Jun-17	15-Oct-23	END	1m	EUR	FAUX	4.5133%	6 473 414.42	4 406 815.84
R24-F	Emprunt 7MEUR Taux fixe 2,7935%	Raiffeisen	01-Dec-12	01-May-16	01-Dec-32	END	1m	EUR	FAUX	2.7935%	7 088 020.87	4 932 056.03
CB15-F	Emprunt 8,9MEUR Taux fixe 3,6%	Autre	01-Jul-16	01-Aug-16	01-Nov-39	END	1m	EUR	FAUX	3.6000%	5 718 860.82	4 901 335.83
UBI2-F	Emprunt 5,9MEUR Taux fixe 4,460028%	UBI Leasing	01-Jun-17	01-Jul-17	01-Nov-22	END	1m	EUR	FAUX	4.4600%	5 868 545.58	3 820 808.53
TRIO3-F	Emprunt 4,75MEUR Taux fixe 1,35%	TRIODOS	28-Jun-18	28-Jun-18	01-Jul-24	END	1m	EUR	FAUX	1.3500%	4 750 000.00	4 750 000.00
R25-F	Emprunt 7MEUR Taux fixe 2,48%	Raiffeisen	30-Jun-16	30-Sep-16	30-Sep-23	END	3m	EUR	FAUX	2.4800%	7 280 000.00	2 340 000.00
BBVA13-F	Emprunt 6MEUR Taux fixe 2,003317%	BBVA	20-May-15	20-Jun-15	20-May-25	END	1m	EUR	FAUX	2.0033%	6 566 783.90	2 767 159.20
BP05-F	Emprunt 4MEUR Taux fixe 0,9491%	Banque Postale	01-Jul-18	01-Aug-18	01-Jul-23	END	1m	EUR	FAUX	0.9491%	4 621 126.88	2 011 272.65
R26-F	Emprunt 4MEUR Taux fixe 3%	Raiffeisen	01-Jul-14	01-Jun-16	01-Jul-34	END	1m	EUR	FAUX	3.0000%	4 709 273.08	3 543 639.81
LEAS4-F	Emprunt 4MEUR Taux fixe 1,6631%	LEASECOM	01-Jul-18	01-Oct-18	01-Jul-23	END	3m	EUR	FAUX	1.6631%	3 818 685.19	1 867 259.44
CB16-F	Emprunt 4MEUR Taux fixe 3,07%	Autre	01-Oct-11	01-May-13	01-Oct-31	END	1m	EUR	FAUX	3.0700%	3 791 248.05	2 550 540.37
CB17-F	Emprunt 3,4MEUR Taux fixe 2,2956%	Autre	01-Aug-15	01-Sep-15	01-Oct-31	END	1m	EUR	FAUX	2.2956%	3 426 262.30	2 469 619.64
CB18-F	Emprunt 3,1MEUR Taux fixe 0%	Autre	01-Jul-16	01-Aug-16	01-Dec-39	END	1m	EUR	FAUX	0.0000%	3 178 723.31	2 260 266.13
CB19-F	Emprunt 3,1MEUR Taux fixe 1,9967%	Autre	01-Jan-12	01-Jun-15	01-Jan-32	END	1m	EUR	FAUX	1.9967%	3 036 466.54	2 326 203.52
CB10-F	Emprunt 3,3MEUR Taux fixe 1,9967%	Autre	01-Jan-12	01-Feb-12	01-Jan-32	END	1m	EUR	FAUX	1.9967%	3 390 843.22	2 273 450.41
HYPO2-F	Emprunt 2,7MEUR Taux fixe 12%	HYPO LANDESBANK	19-Nov-14	01-Feb-16	01-Apr-50	END	6m	EUR	FAUX	12.0000%	2 700 764.34	2 375 120.08
CB11-F	Emprunt 3,4MEUR Taux fixe 2%	Autre	01-Jan-12	01-Jun-15	01-Jan-32	END	1m	EUR	FAUX	2.0000%	3 029 404.69	2 180 871.76
HYPO3-F	Emprunt 3MEUR Taux fixe 9%	HYPO LANDESBANK	01-Oct-15	01-Oct-15	01-Nov-34	END	6m	EUR	FAUX	9.1000%	2 515 468.98	2 166 526.27
SGL4-F	Emprunt 4,3MEUR Taux fixe 0,6992%	SOGELEASE	22-Dec-16	31-Mar-17	31-Dec-21	END	3m	EUR	FAUX	0.6992%	4 381 215.91	509 202.60
SGL4-F	Emprunt 4,3MEUR Taux fixe 3,2%	SOGELEASE	25-Jun-13	01-Jul-13	01-Jan-23	END	3m	EUR	FAUX	3.2000%	3 730 314.73	1 887 462.55
BBVA14-F	Emprunt 3,56MEUR Taux fixe 2,037914%	BBVA	20-May-15	20-Jun-15	20-Jun-25	END	1m	EUR	FAUX	2.0379%	3 535 932.67	1 489 997.16
CB12-F	Emprunt 2,7MEUR Taux fixe 0%	Autre	01-Oct-14	01-Nov-14	01-Oct-37	END	1m	EUR	FAUX	0.0000%	2 748 556.25	1 958 971.00
CECA5-F	Emprunt 3,9MEUR Taux fixe 1,8473%	CECA	24-Nov-16	01-Jan-17	01-Dec-21	END	1m	EUR	FAUX	1.8473%	3 991 488.37	422 775.50
NATIOCR1-F	Emprunt 2,9MEUR Taux fixe 2,2922%	NATIOCREDIMURS	01-Nov-17	01-Jan-18	01-Jan-23	END	3m	EUR	FAUX	2.2791%	2 981 581.86	1 101 516.22
CB13-F	Emprunt 3,5MEUR Taux fixe 3,2779%	Autre	01-Dec-12	01-Jan-13	01-Oct-31	END	1m	EUR	FAUX	3.2779%	3 516 517.30	1 877 554.91
BBVA15-F	Emprunt 3,3MEUR Taux fixe 2,037917%	BBVA	20-May-15	20-Jun-15	20-Jun-25	END	1m	EUR	FAUX	2.0379%	3 301 024.29	1 391 009.76
CB14-F	Emprunt 3,32MEUR Taux fixe 2,594378%	Autre	01-Dec-12	01-Dec-13	01-Oct-31	END	1m	EUR	FAUX	2.5944%	3 325 690.44	1 824 383.36
CB15-F	Emprunt 2,12MEUR Taux fixe 2,000004%	Autre	01-Dec-12	01-Jun-15	01-Jan-32	END	1m	EUR	FAUX	2.5000%	3 325 690.44	1 965 683.12
BNP46-F	Emprunt 3,36MEUR Taux fixe 4,79%	BNP	23-Mar-11	23-Mar-11	08-Apr-26	END	1m	EUR	FAUX	4.7900%	3 360 000.00	1 358 201.66
HYPO4-F	Emprunt 1,9MEUR Taux fixe 9,15%	HYPO LANDESBANK	27-Apr-09	01-Dec-15	01-May-36	END	6m	EUR	FAUX	9.1500%	1 933 701.15	1 722 875.41
CB16-F	Emprunt 2,2MEUR Taux fixe 2,3%	Autre	01-Jul-15	01-Aug-15	01-Jan-32	END	1m	EUR	FAUX	2.9560%	2 218 711.94	1 602 087.40
MILLE04-F	Emprunt 1,9MEUR Taux fixe 1,4%	Bank Millennium	15-Jun-18	15-Jun-18	15-May-30	END	1m	EUR	FAUX	1.4000%	1 923 713.03	1 470 488.66
R27-F	Emprunt 2,1MEUR Taux fixe 1,8999996%	Raiffeisen	01-Feb-16	01-Mar-16	01-Feb-25	END	1m	EUR	FAUX	1.9000%	2 579 213.78	1 128 451.57
KBC16-F	Emprunt 2,3MEUR Taux fixe 0,82%	KBC	15-Jul-16	15-Aug-16	15-Jul-23	END	1m	EUR	FAUX	0.8194%	2 386 261.06	749 768.46
LEAS6-F	Emprunt 3,3MEUR Taux fixe 1,739013%	LEASECOM	27-Jun-16	01-Oct-16	01-Jul-21	END	3m	EUR	FAUX	1.7315%	3 352 341.36	183 412.21
CECA6-F	Emprunt 1,74MEUR Taux fixe 5,3%	CECA	19-May-09	19-Jun-09	05-Oct-27	END	1m	EUR	FAUX	5.3000%	1 740 000.00	904 303.44
CADEP17-F	Emprunt 23MCHF Taux fixe 2,0000%	CAISSE D'EP	05-Apr-19	11-Apr-19	05-Apr-26	END	1m	EUR	FAUX	2.0000%	23 000 000.00	16 221 581.56
OCE1-F	Obligation convertible OCEANE à 0.375%	OCEANE	17-May-19	17-May-19	17-May-27	END	12m	EUR	FAUX	0.3750%	499 999 958.50	499 999 958.50
IMPULS2-F	Emprunt 1,079ME Taux fixe 2,650004%	Impuls Leasing	01-Jan-18	01-Feb-18	01-Jan-26	END	1m	EUR	FAUX	2.6500%	1 079 137.41	657 080.67
LEAS7-F	Emprunt 1,5ME Taux fixe 1,304753%	LEASECOM	01-Jul-17	01-Oct-17	01-Jul-22	END	3m	EUR	FAUX	1.3048%	1 433 900.61	385 985.53
CAGR27-F	Emprunt 1,35ME Taux fixe 4,9%	CA	19-Dec-11	28-Dec-11	05-Jan-27	END	1m	EUR	FAUX	4.9000%	1 350 000.00	650 686.80
AUT05-F	Emprunt 1,2ME Taux fixe 6,703054%	Autre	01-Dec-10	01-Jan-11	01-Dec-30	END	1m	EUR	FAUX	6.7031%	1 097 811.14	701 283.38
KBC18-F	Emprunt 1,49ME Taux fixe 1,270352%	KBC	03-Apr-18	03-May-18	03-Feb-23	END	1m	EUR	FAUX	1.2704%	1 018 944.77	374 007.16
BAWAG2-F	Emprunt 1,2ME Taux fixe 0,5%	BAWAG PSK	01-Jan-07	30-Jun-07	30-Jun-37	END	12m	EUR	FAUX	5.0000%	1 220 903.50	673 833.60
BMPB03-F	Emprunt 1,73ME Taux fixe 2,2313%	Banca Monte Paschi Belgio	16-Nov-15	01-Jan-19	16-Sep-22	END	3m	EUR	FAUX	2.3130%	844 747.74	289 449.59
NATX18-F	Emprunt 25,6 ME Taux fixe 1,249896%	NATIXIS	27-Jun-19	01-Aug-19	01-Jul-24	END	1m	EUR	FAUX	1.2499%	25 836 981.37	16 387 906.46
BP06-F	Emprunt 15 ME Taux fixe 1,155191%	Banque Postale	21-Jun-19	01-Aug-19	01-Jul-24	END	1m	EUR	FAUX	1.5519%	14 766 765.59	9 358 291.93

Detail Dette Taux Fixe (4/5)

Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade Date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Payment Frequency	Currency	Amortizing	Rate	Initial notional	Current Amount
BANCO2-F	ORPEA Emprunt standard -1612	BANCO BPM	30-Sep-16	01-Jan-19	30-Sep-31	END	3m	EUR	FAUX	1.8000%	1 965 777.04	1 614 961.87
SSD37-F	SCHULDSCHHEIN 8M EUR, Taux fixe 1.4%	SCHULDSCHHEIN	16-Jul-19	22-Jul-19	22-Jul-24	END	12m	EUR	FAUX	1.4000%	8 000 000.00	8 000 000.00
SSD38-F	SCHULDSCHHEIN 8.5M EUR, Taux fixe 1.7%	SCHULDSCHHEIN	16-Jul-19	22-Jul-19	22-Jul-24	END	12m	EUR	FAUX	1.7000%	8 500 000.00	8 500 000.00
AUT26-F	Emprunt Standard 2,2M EUR, Taux fixe	Autre	30-Dec-18	30-Dec-18	31-Dec-80	END	3m	EUR	FAUX	6.0000%	2 202 813.84	2 218 497.55
R34-F	Emprunt Standard 2,2M EUR, Taux fixe	RAIFFEISEN LANDESBANK	30-Jun-17	30-Jun-17	30-Sep-22	END	3m	EUR	FAUX	4.0000%	1 699 193.55	522 227.50
SPAR6-F	Emprunt Manuel 6M EUR, Taux fixe	SPARKASSE	06-Oct-17	06-Oct-17	01-May-30	END	1m	EUR	FAUX	0.5000%	6 071 872.38	4 428 333.72
SSD42-F	SCHULDSCHHEIN 4.5M EUR, Taux fixe 1.4%	SCHULDSCHHEIN	16-Jun-19	22-Jul-19	22-Jul-24	END	12m	EUR	FAUX	1.4000%	4 500 000.00	4 500 000.00
SPAR7-F	Emprunt Manuel 1,44M EUR, Taux fixe	SPARKASSE	06-Oct-17	06-Oct-17	31-Oct-32	END	6m	EUR	FAUX	5.5000%	1 441 230.35	1 102 561.74
AUT27-F	Emprunt Standard 50M EUR, Taux fixe	Autre	26-Jul-19	31-Jul-19	31-Jul-31	END	12m	EUR	FAUX	2.5000%	50 000 000.00	50 000 000.00
R37-F	Emprunt Manuel 3,1M EUR, Taux fixe	RAIFFEISEN BANK CZ	01-Oct-17	01-Oct-17	15-Jun-30	END	3m	EUR	FAUX	2.3700%	3 101 301.40	2 342 181.30
ERB6-F	Emprunt Manuel 3,675M EUR, Taux fixe	ERSTE BANK	30-Jun-17	30-Jun-17	30-Apr-22	END	3m	EUR	FAUX	2.4300%	3 675 896.59	791 036.59
SPAR8-F	Emprunt Manuel 1,69M EUR, Taux fixe	SPARKASSE	06-Oct-17	06-Oct-17	01-May-30	END	3m	EUR	FAUX	1.5000%	1 503 705.97	1 102 182.39
ERB7-F	Emprunt Standard 5,13M EUR, Taux fixe	ERSTE BANK	18-Feb-15	30-Jun-17	31-Jul-28	END	3m	EUR	FAUX	2.3790%	4 834 498.43	4 834 498.43
OB5-F	Emprunt Manuel 1,16M EUR, Taux fixe	OBERBANK	30-Sep-17	30-Sep-17	15-Sep-28	END	1m	EUR	FAUX	1.6300%	1 160 729.32	794 372.46
AUT29-F	Emprunt Standard 2M EUR, Taux fixe	Autre	30-Apr-08	30-Apr-08	30-Apr-24	END	6m	EUR	FAUX	4.5000%	2 000 000.00	500 000.00
AUT30-F	Emprunt Manuel 2,06M EUR, Taux fixe	Autre	02-Jul-18	02-Jul-18	01-Jun-25	END	1m	EUR	FAUX	7.5000%	919 136.23	509 119.78
OB6-F	Emprunt Manuel 1,21M EUR, Taux fixe	OBERBANK	30-Sep-17	30-Sep-17	05-Dec-21	END	3m	EUR	FAUX	1.3750%	1 211 785.74	216 136.78
SPAR9-F	Emprunt Standard 1,05M EUR, Taux fixe	Taunus Sparkasse	31-Mar-18	31-Mar-18	28-Feb-23	END	1m	EUR	FAUX	3.7500%	816 261.46	307 899.36
SO203-F	Emprunt Standard 1,05M EUR, Taux fixe	BANK FÜR SOZIALWIRTSCHAFT	24-Jun-13	31-Mar-18	31-Mar-23	END	1m	EUR	FAUX	3.7500%	816 261.46	299 295.78
OB7-F	Emprunt Standard 956,5K EUR, Taux fixe	OBERBANK	30-Sep-17	30-Sep-17	05-Mar-22	END	3m	EUR	FAUX	1.3750%	956 615.14	217 780.00
OB8-F	Emprunt Manuel 748K EUR, Taux fixe	OBERBANK	30-Sep-17	30-Sep-17	01-Mar-24	END	3m	EUR	FAUX	3.2500%	748 568.43	363 771.12
AUT31-F	Location financière 750K EUR, Taux fixe	Autre	12-May-06	01-Mar-08	01-Mar-33	END	1m	EUR	FAUX	5.6764%	748 862.75	481 277.22
AUT32-F	Location financière 723K EUR, Taux fixe	Autre	20-Nov-06	01-Jul-08	01-Jul-23	END	1m	EUR	FAUX	5.6000%	722 090.56	471 715.32
IMPULS3-F	Location financière 1,72M EUR, Taux fixe	IMPULS LEASING	30-Sep-14	01-Oct-14	01-Jul-21	END	1m	EUR	FAUX	3.3556%	1 710 180.18	47 128.29
SPAR10-F	Emprunt Standard 9,673M EUR, Taux Fixe	SPARKASSE	30-Jun-19	30-Jun-19	31-Aug-33	END	1m	EUR	FAUX	3.9800%	7 568 255.18	6 726 777.79
SPAR11-F	Emprunt Standard 2.3M EUR, Taux Fixe	SPARKASSE MINDEN LÜBBECKE	30-Jan-07	01-Jun-19	01-Jun-31	END	1m	EUR	FAUX	3.5000%	1 447 024.33	1 245 726.06
BTAR03-F	Emprunt Standard 8M EUR, Taux Fixe	BANQUE TARNEAUD	20-Nov-19	02-Dec-19	28-Nov-24	END	3m	EUR	FAUX	0.8900%	8 000 000.00	5 637 226.53
BBVA17-F	Emprunt Standard 5,5 M EUR, Taux Fixe	BBVA	18-Nov-19	18-Nov-19	18-Nov-34	END	1m	EUR	FAUX	2.0000%	4 919 452.54	4 851 206.69
CADEP21-F	Emprunt Standard 20M EUR, Taux Fixe	Caisse d'Epargne et de Prévoyance Grand Est Europe	29-Nov-19	18-Feb-20	05-Mar-26	END	3m	EUR	FAUX	0.9000%	20 000 000.00	15 921 825.75
HYPO5-F	Emprunt Standard 2,15M EUR, Taux Fixe	Hypo Landesbank Vorarlberg	22-Jan-20	28-Feb-20	30-Jun-33	END	6m	EUR	FAUX	1.1220%	2 150 000.00	1 911 110.00
SPAR9-F	Emprunt Standard 1,08M eur, Taux Fixe	Sparkasse Minden Lubbecke	30-Jan-07	01-Jun-19	01-Jun-29	END	1m	EUR	FAUX	3.9000%	661 960.92	552 975.61
SPAR10-F	Emprunt Standard 1,025M eur, Taux Fixe	Sparkasse Minden Lubbecke	19-Sep-13	01-Jun-19	01-Apr-29	END	1m	EUR	FAUX	3.5000%	727 334.34	598 788.42
SPAR11-F	Emprunt Standard 1,27M eur, Taux Fixe	Sparkasse Minden Lubbecke	30-Jan-07	01-Jun-19	01-Apr-30	END	1m	EUR	FAUX	3.9000%	810 412.99	684 845.49
CB17-F	CBI, 22,6 M EUR, Taux fixe	Autres	27-Dec-19	01-Jan-20	01-Jan-25	END	1m	EUR	VRAI	1.2541%	22 693 726.63	16 407 578.43
CB18-F	CBI, 2,3 M EUR, Taux fixe	Autres	30-Dec-19	05-Feb-20	05-Jan-26	END	1m	EUR	FAUX	0.6905%	2 372 166.00	1 851 279.50
BPI24-F	Emprunt standard 5 MEUR, Taux fixe	BPI	31-Mar-15	06-May-20	31-Dec-23	END	3m	EUR	FAUX	2.4900%	2 777 777.72	1 851 851.77
BTAR04-F	Emprunt standard 8 MEUR, Taux fixe	Banque Tarneaud	17-Sep-20	17-Sep-20	17-Sep-26	END	3m	EUR	FAUX	1.0800%	8 000 000.00	7 028 070.04
AUT40-F	Emprunt standard 2 MEUR, Taux fixe	Banco Santander	29-Sep-20	01-Oct-20	29-Sep-23	END	6m	EUR	FAUX	2.0000%	2 000 000.00	2 000 000.00
AUT41-F	Emprunt standard 77 MEUR, Taux fixe	Pool	25-Nov-20	30-Nov-20	30-Nov-27	END	12m	EUR	FAUX	2.5640%	77 000 000.00	77 000 000.00
AUT46-F	Euro PP 60 MEUR, Taux fixe	Pool	16-Dec-20	18-Dec-20	18-Dec-28	END	12m	EUR	FAUX	2.7700%	60 000 000.00	60 000 000.00
EIFF01-F	Euro PP 15 MEUR, Taux fixe	Pool	16-Dec-20	18-Dec-20	18-Dec-30	END	12m	EUR	FAUX	3.0700%	15 000 000.00	15 000 000.00
OLB02-F	Emprunt 20 MEUR, Taux fixe	OLB	19-Apr-21	27-Apr-21	30-Jun-28	END	3m	EUR	FAUX	2.2000%	20 000 000.00	20 000 000.00
SOGE18-F	Emprunt 500 MEUR, Taux fixe	SOCGEN	30-Mar-21	01-Apr-21	01-Apr-28	END	12m	EUR	FAUX	2.0000%	500 000 000.00	500 000 000.00
											Total EUR	3 406 010 074.45
												3 032 564 157.55
POL1-D	ORPEA SA - Emprunt amortissable	Not specified	01-Feb-18	01-Feb-18	31-Oct-31	END	3m	PLN	FAUX	0.0000%	11 322 300.00	8 622 304.00
											Total PLN	11 322 300.00
												8 622 304.00

Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade Date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Payment Frequency	Currency	Amortizing	Rate	Initial notional	Current Amount
-------------	-------------------	--------------	------------	----------------	---------------	----------------	-------------------	----------	------------	------	------------------	----------------

KERIUS Finance Suisse SARL
Rue Cardinal Journet 27,
1217 Meyrin - Genève, Suisse

Tel : + 41 22 566 40 52

RC Genève, numéro fédéral: CH-660-2330011-1

KERIUS Finance SAS
17 rue Dupin,
75006 Paris, France

Tel: +33 1 83 62 27 61

RC Paris: 520 300 948

Immatriculé au Registre Unique des Intermédiaire en Assurance, Banque et Finance (ORIAS) sous le n°13000716 au titre des activités de **Conseiller en Investissements Financiers**, enregistré auprès de l'Association Nationale des Conseils Financiers-CIF, association agréée par l'Autorité des Marchés Financiers .

www.kerius-finance.com

Sébastien Rouzaire
s.rouzaire@kerius-finance.com

Ce document a été préparé à l'usage des services financiers du Client. Ce document ou son contenu ne doivent pas être communiqués ou diffusés en externe sans l'accord préalable écrit de KERIUS FINANCE .

Pour ce document, KERIUS FINANCE a été amenée à utiliser des informations et données chiffrées fournies par le Client. KERIUS FINANCE a pris ces données en compte sans réaliser de procédure d'audit et n'émettra en conséquence aucune opinion sur leur fiabilité. Ce document ne constitue pas une documentation contractuelle des transactions éventuellement décrites, ni une recommandation ou une sollicitation de mettre en place les transactions décrites. Tout Client intéressé par ce type de transactions ou procédure doit mener ses propres analyses pour vérifier l'adéquation à ses besoins, ainsi que les conséquences, notamment fiscales et comptables. Il lui appartient également de prendre les dispositions nécessaires à la mise en œuvre des décisions qu'il aura prises.

Ni KERIUS FINANCE ou ses administrateurs ou employés ne pourront être tenus responsables des conséquences de l'utilisation de ce document ou de la mise en place, totale ou partielle, par le client, des idées ou opérations décrites.

This document has been prepared for the Finance department of the Client. It must not be communicated or published externally without prior written consent of KERIUS FINANCE

For this document, KERIUS FINANCE used information and data provided by the Client. The Client agrees that KERIUS FINANCE took this information into account without auditing them or checking their accuracy and, as a consequence, without producing any opinion on their reliability. Please note that this document does not constitute a contractual documentation of the transactions or processes that may be described, nor a recommendation or solicitation to enter into the transactions or processes described herein. If the Client is interested in setting up this type of transactions or processes, the Client should conduct his own analysis of the suitability to his needs. The Client must also verify the consequences of his decisions, including accounting and fiscal aspects. The Client is also responsible for the implementation of his decisions.

Neither KERIUS FINANCE nor its directors and employees accept liability for any loss or damage resulting from the use of this document and expressly excludes all liability in respect of any implication of the described ideas or transactions on the Client's own specific particulars.