



Les marchés financiers en toute sérénité



Cartographie des couvertures

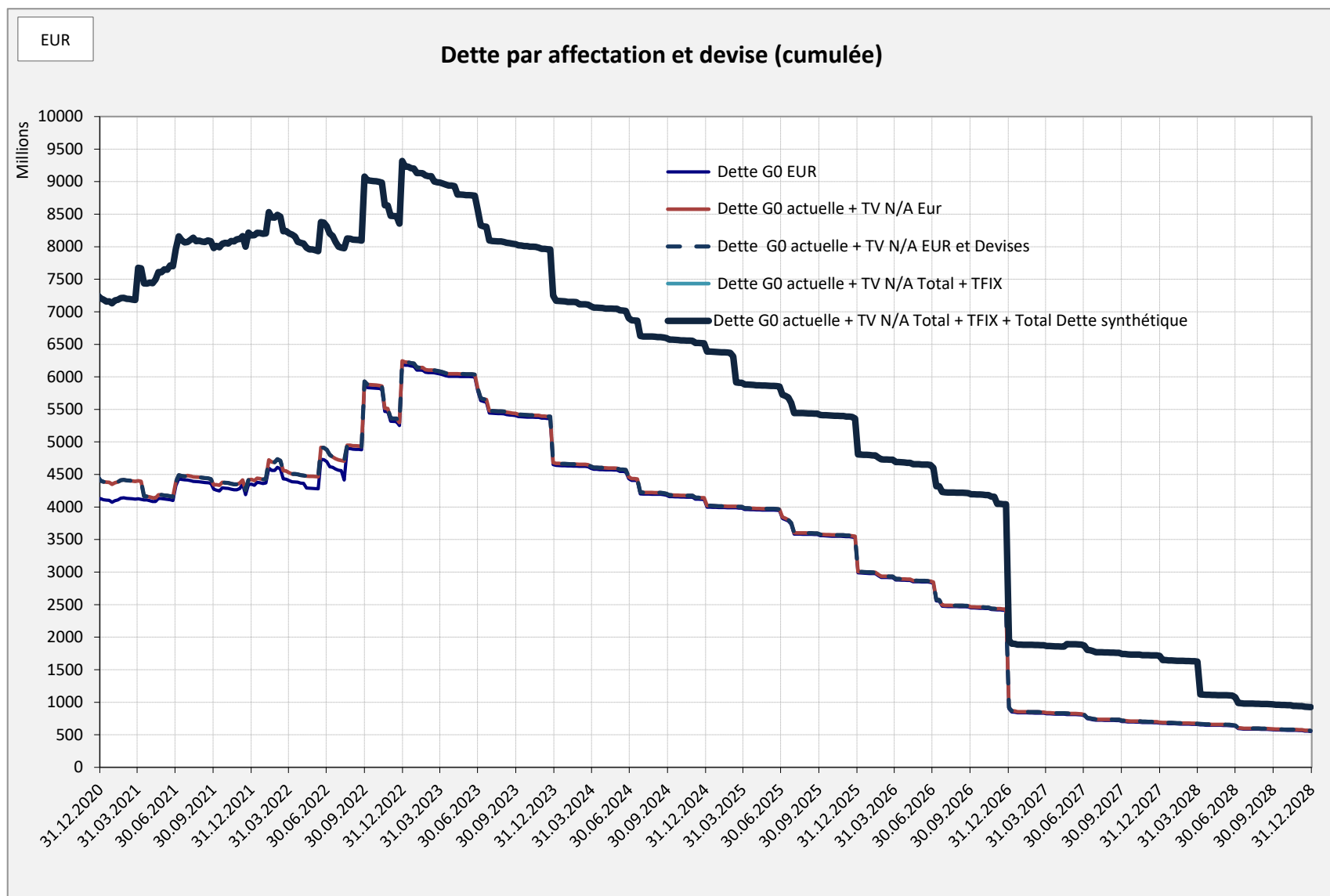
31 Mars 2023

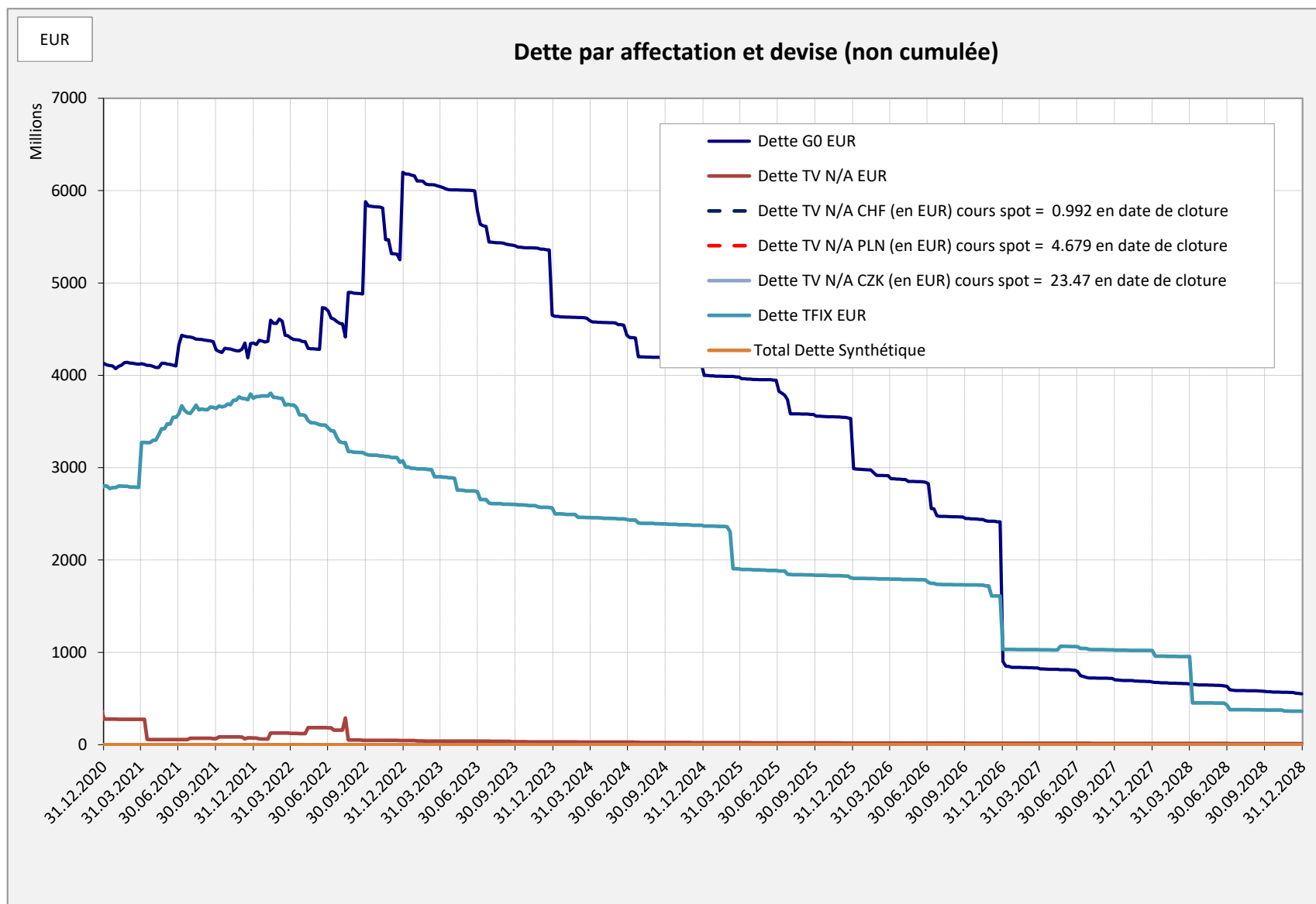
KERIUS Finance SAS

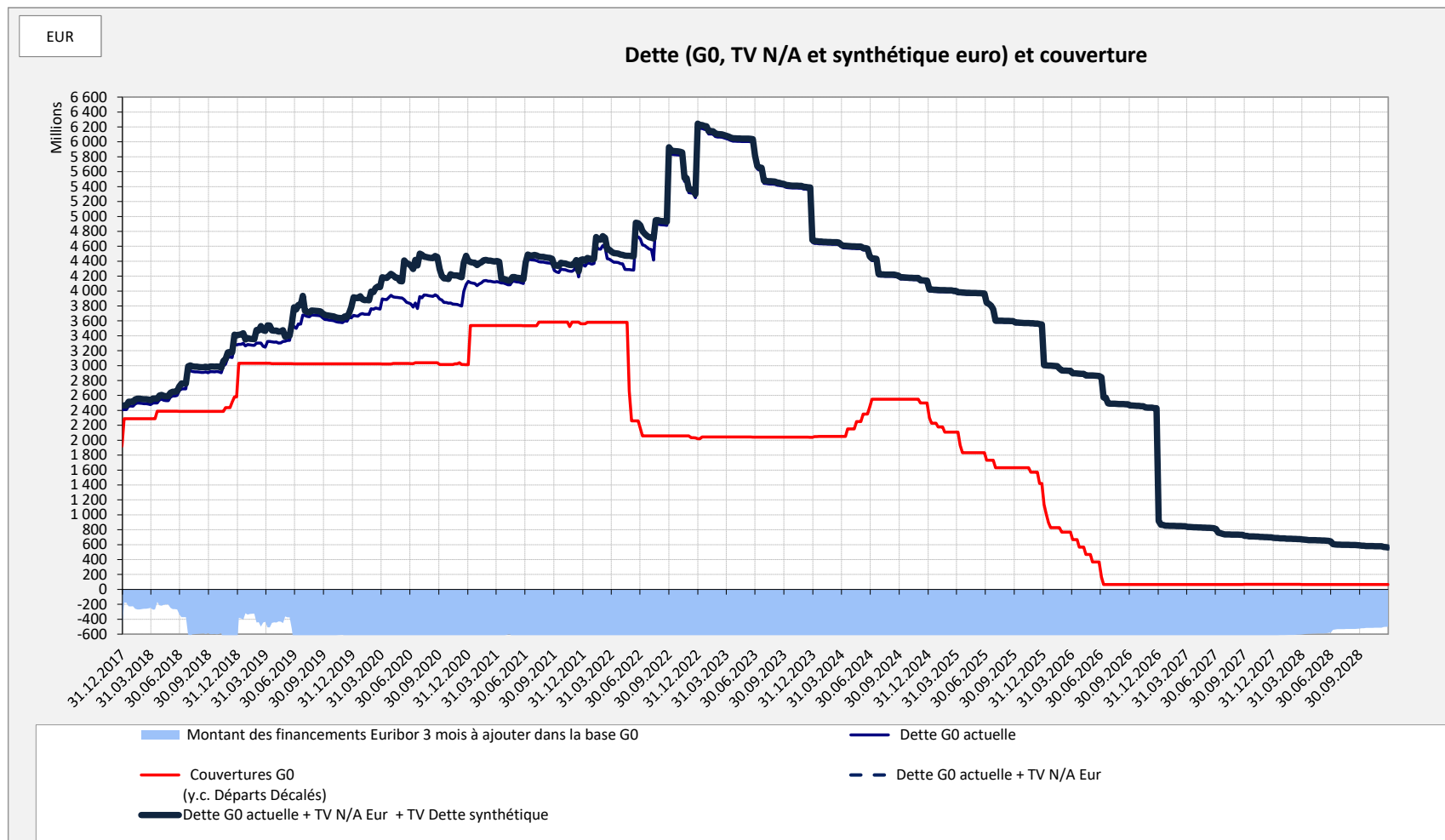
Conseiller en Investissements Financiers

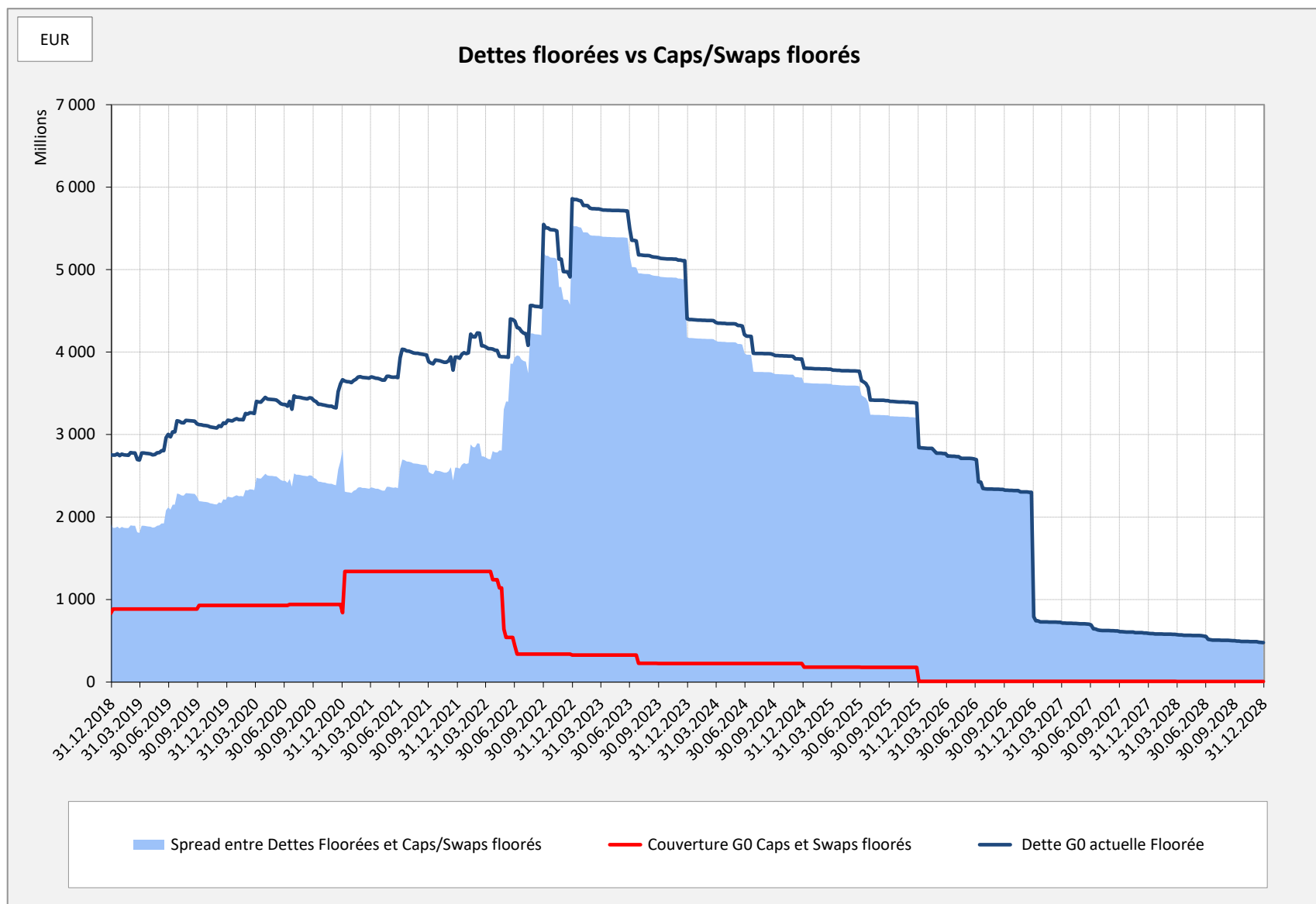
Membre de l'ANACOFI CIF- Association agréée par l'AMF - ORIAS N° 13000716

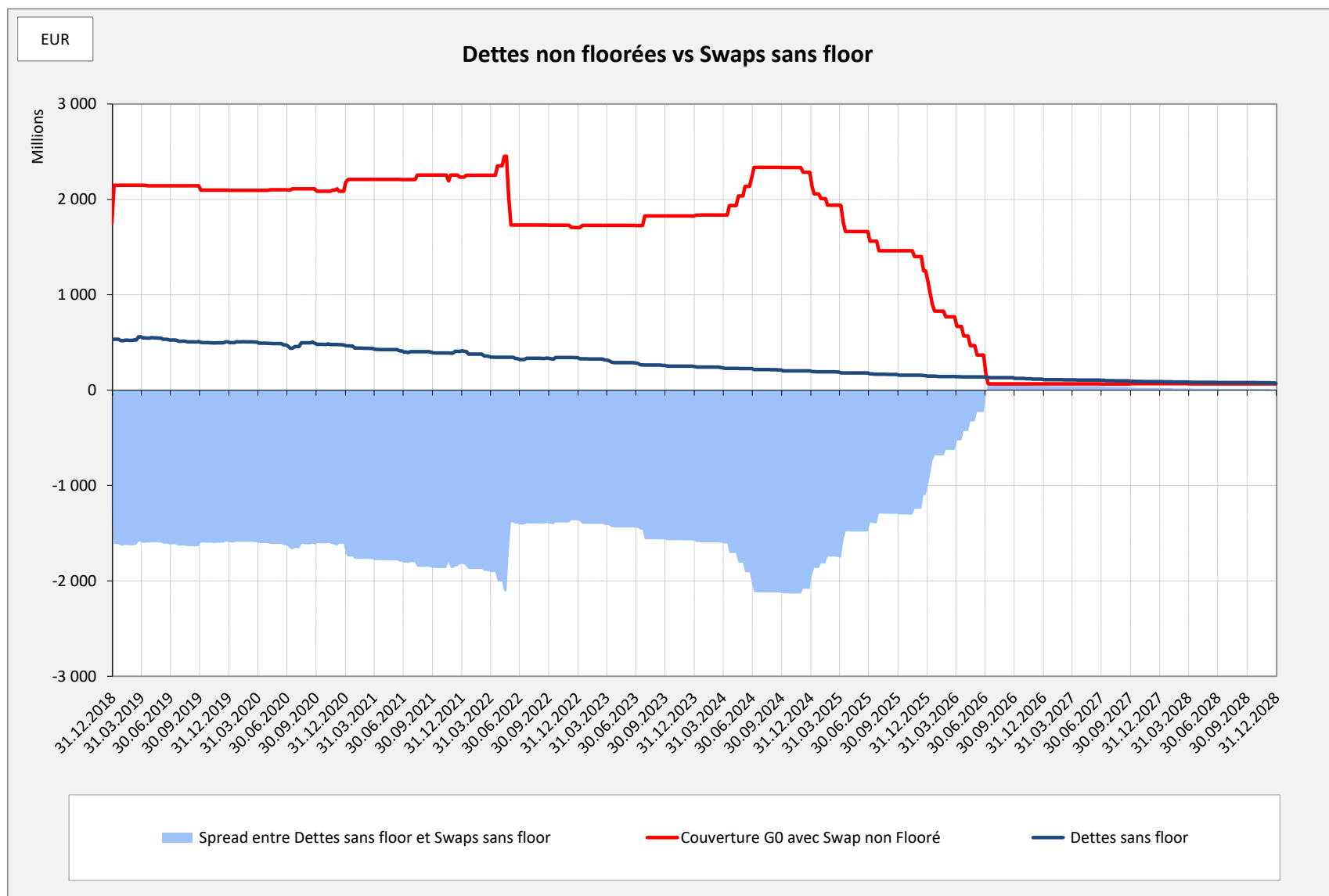
31 Mars 2023

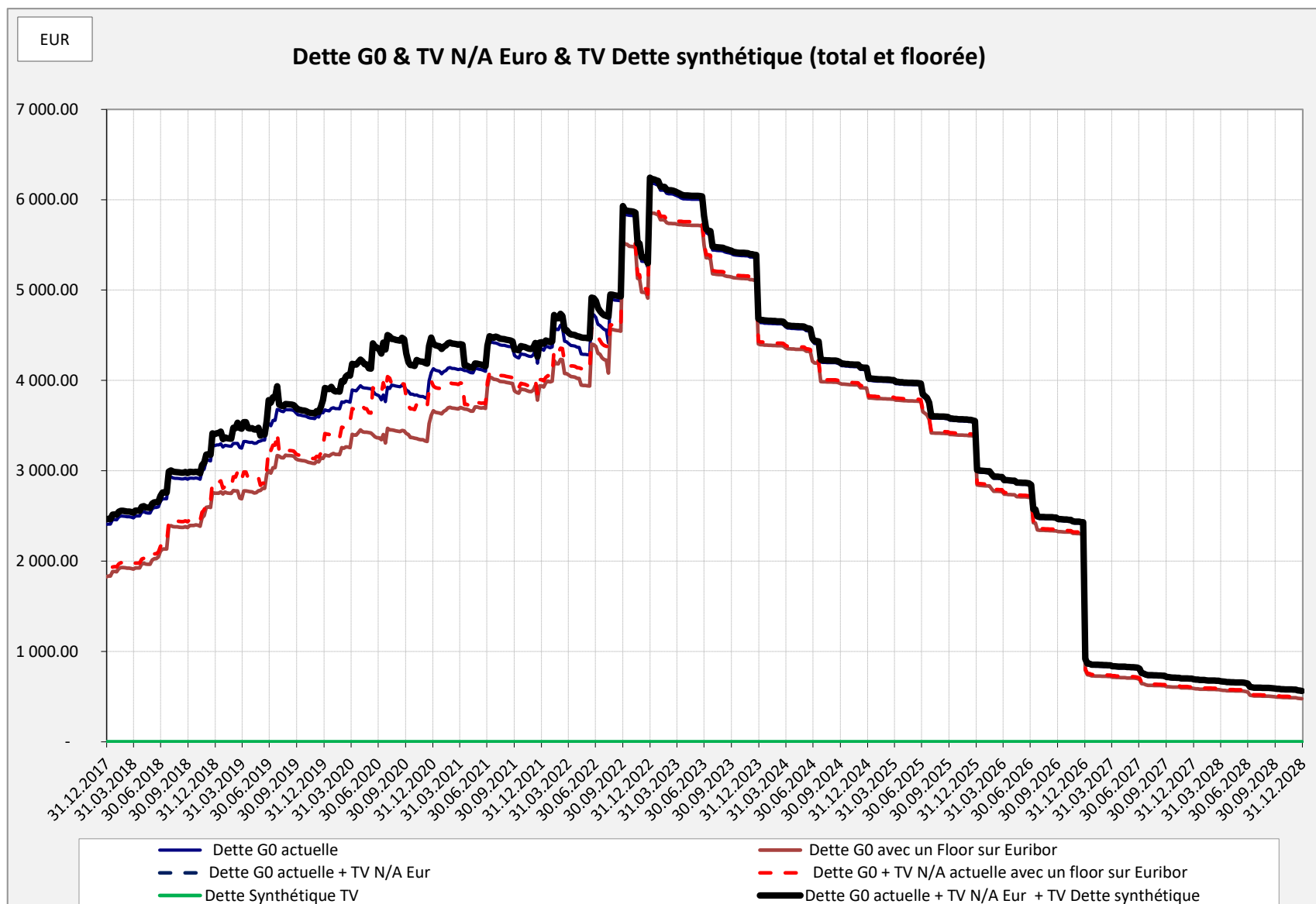


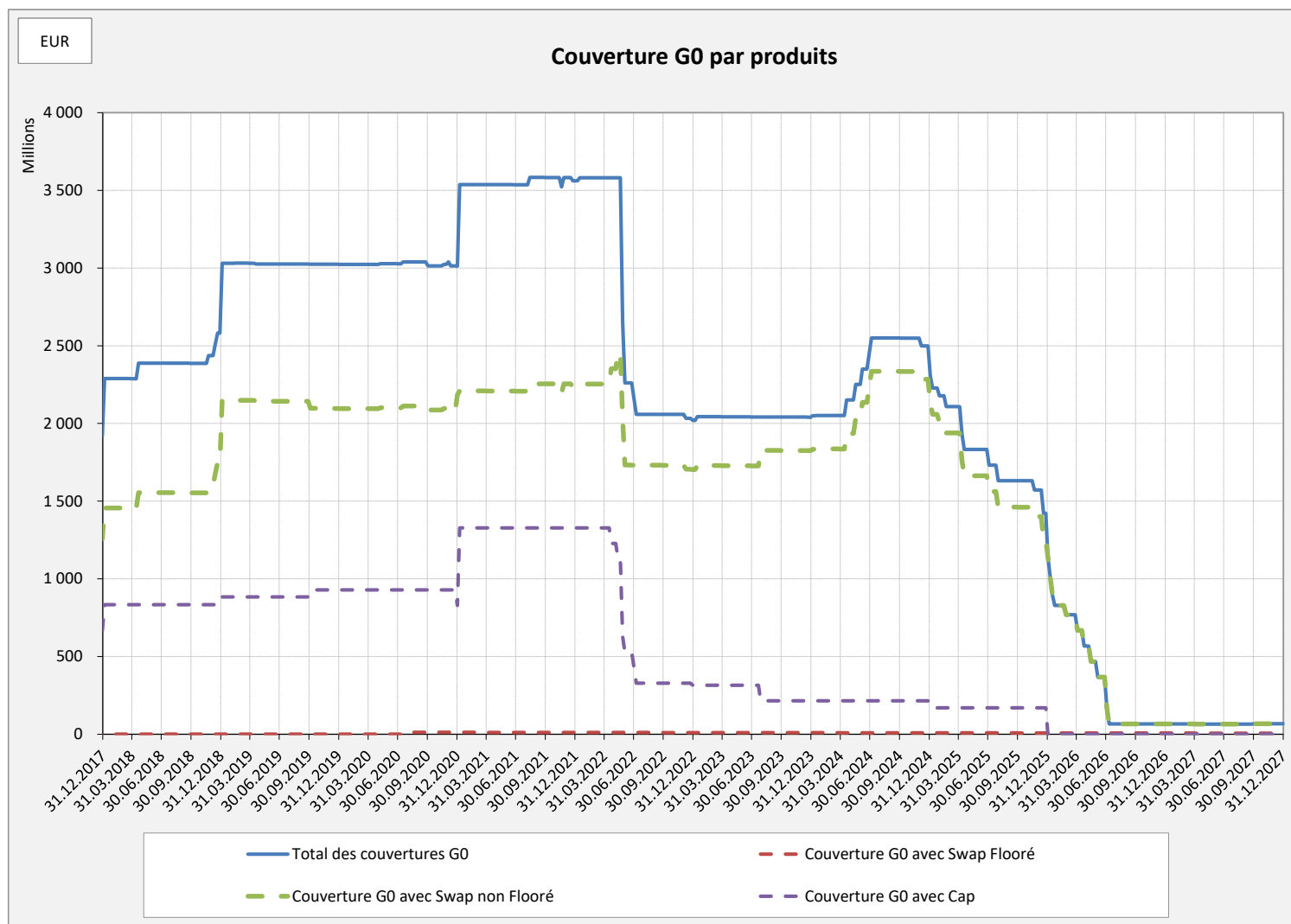


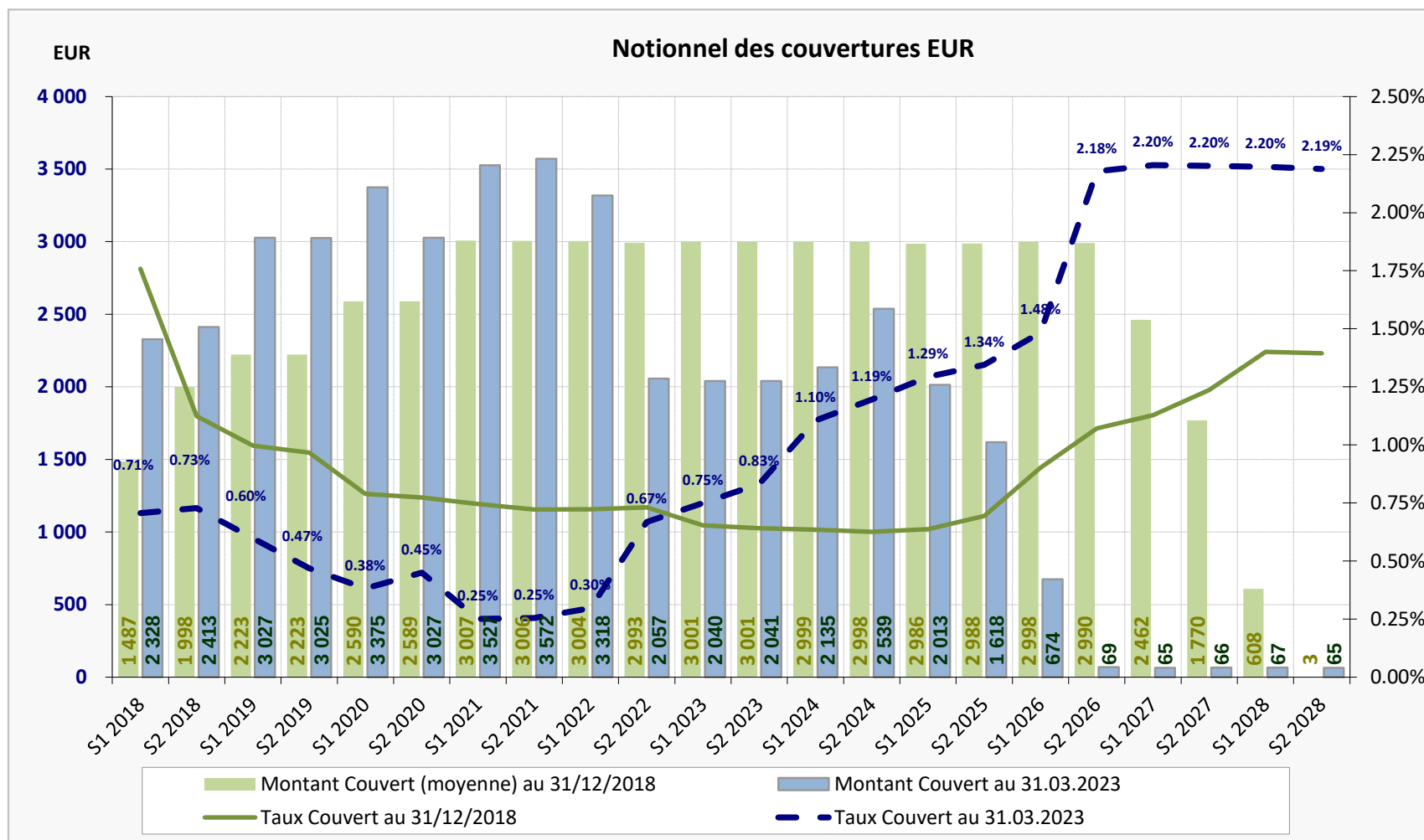


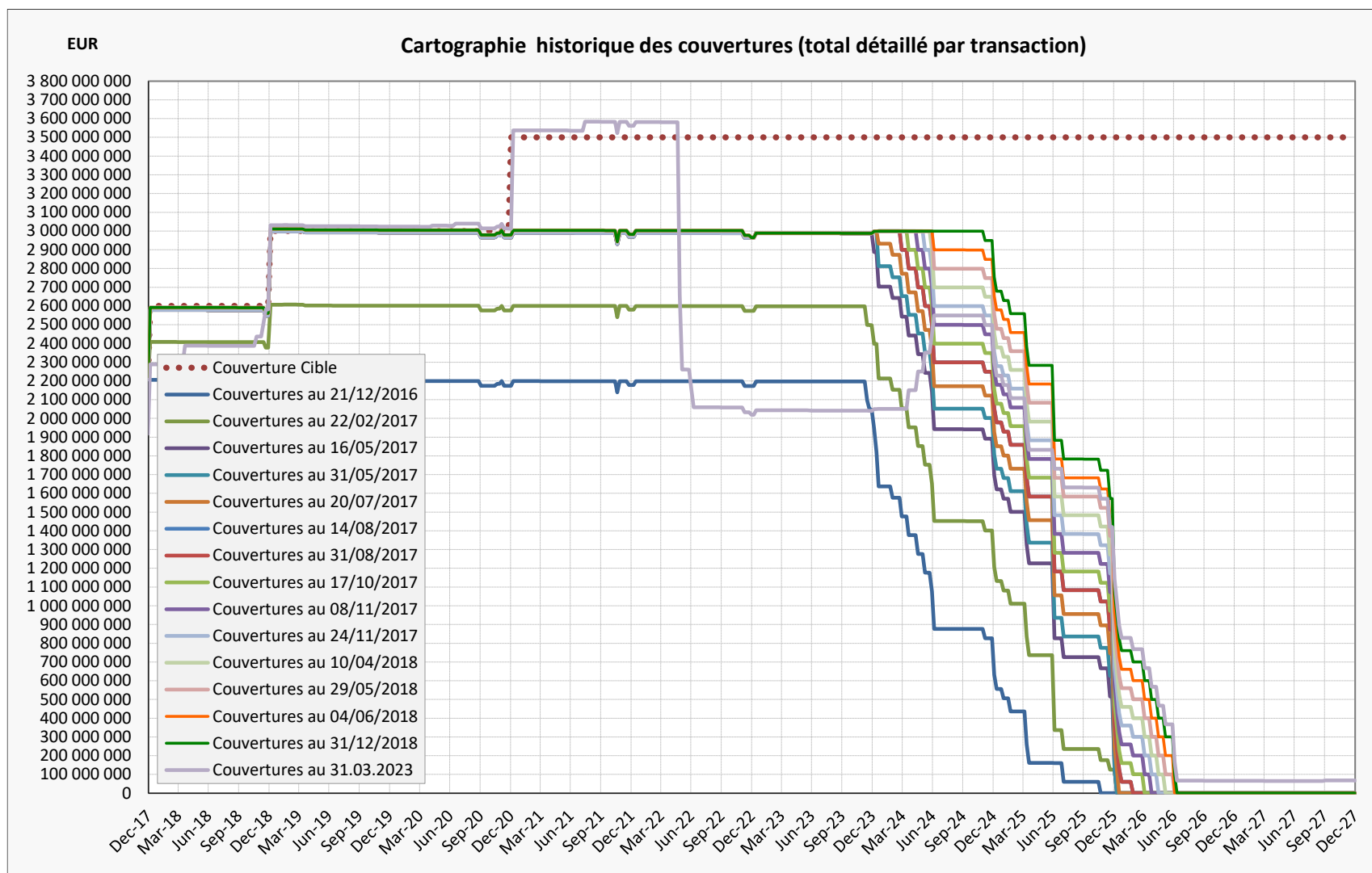




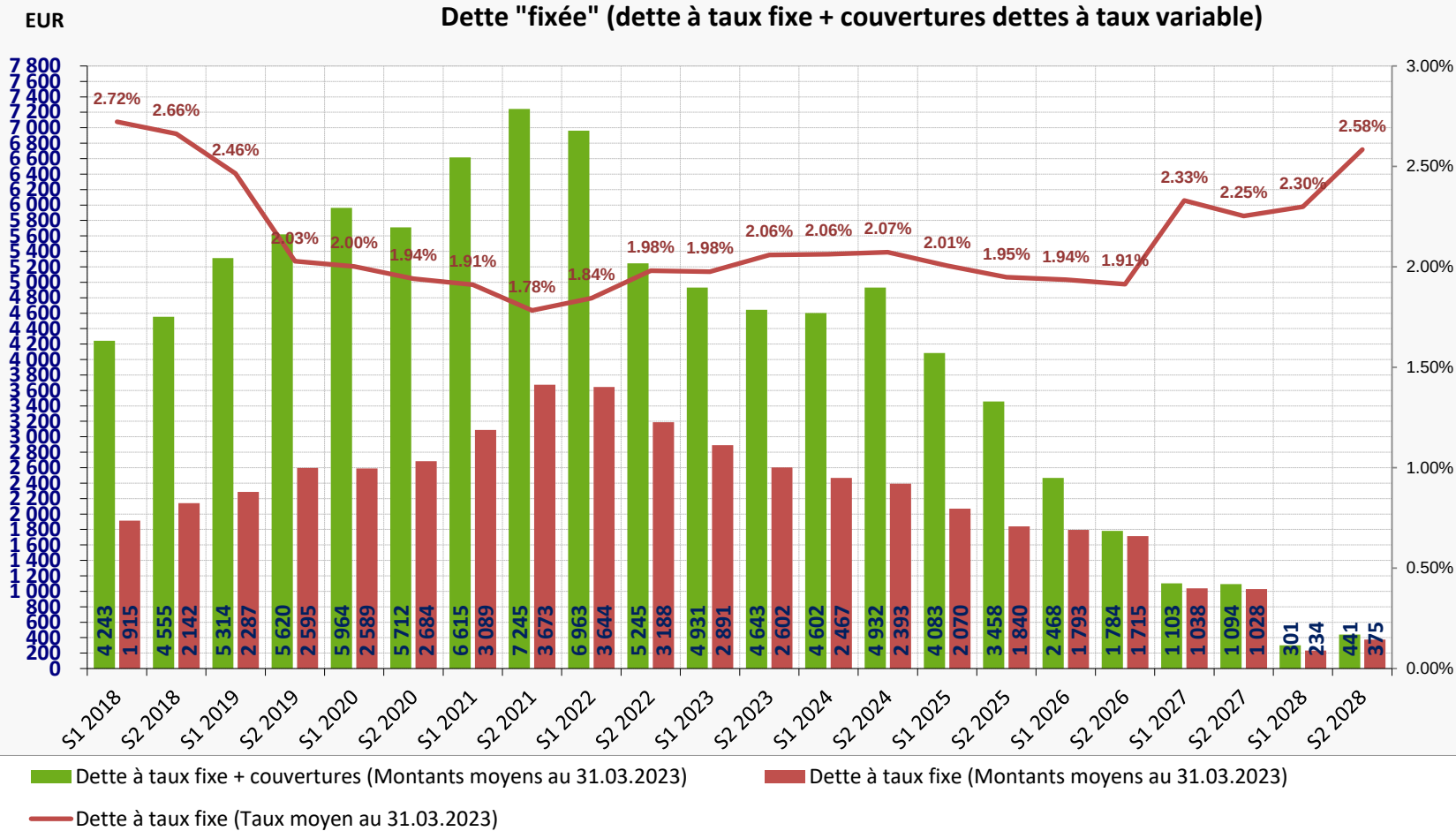






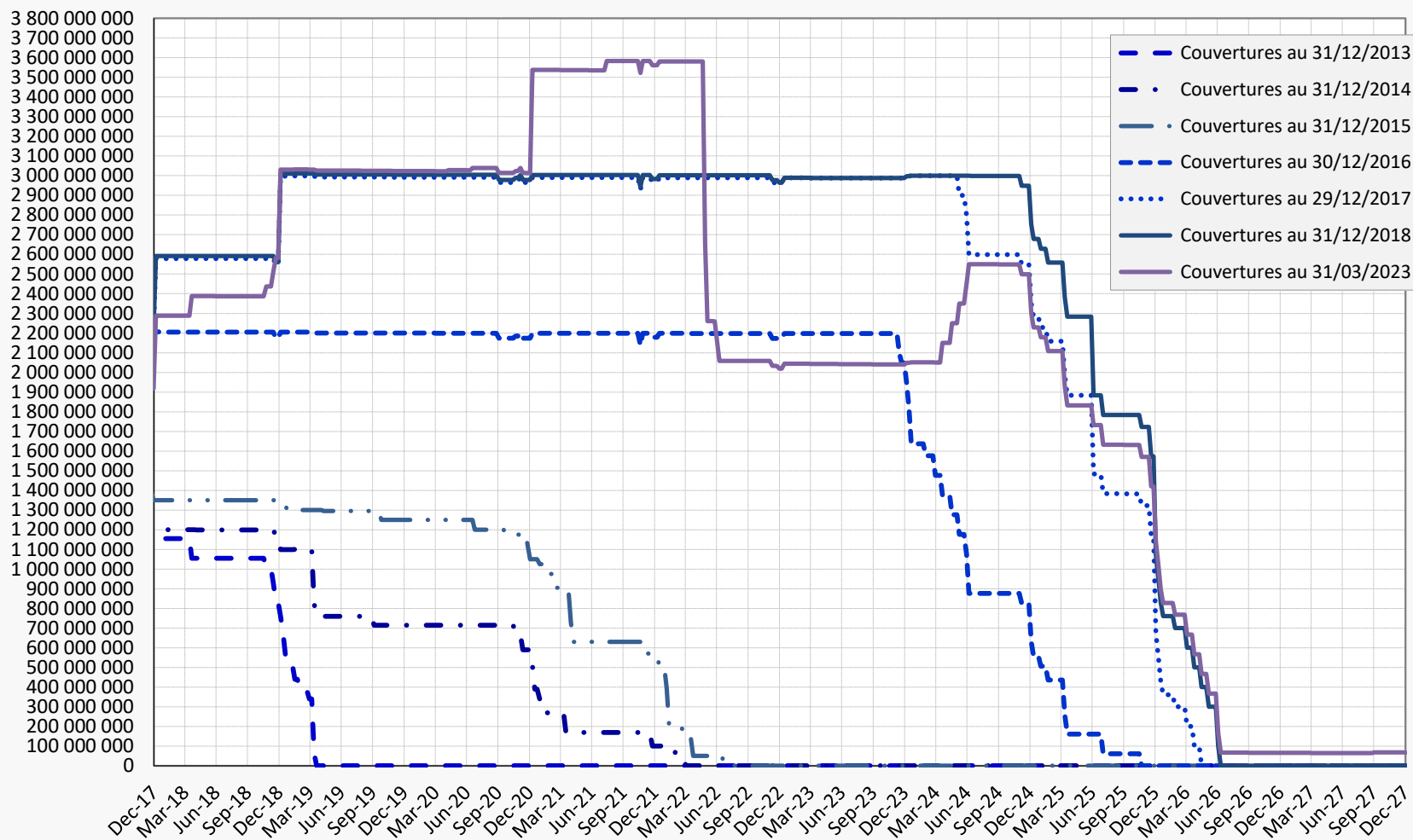


Dette "fixée" (dettes à taux fixe + couvertures dettes à taux variable)

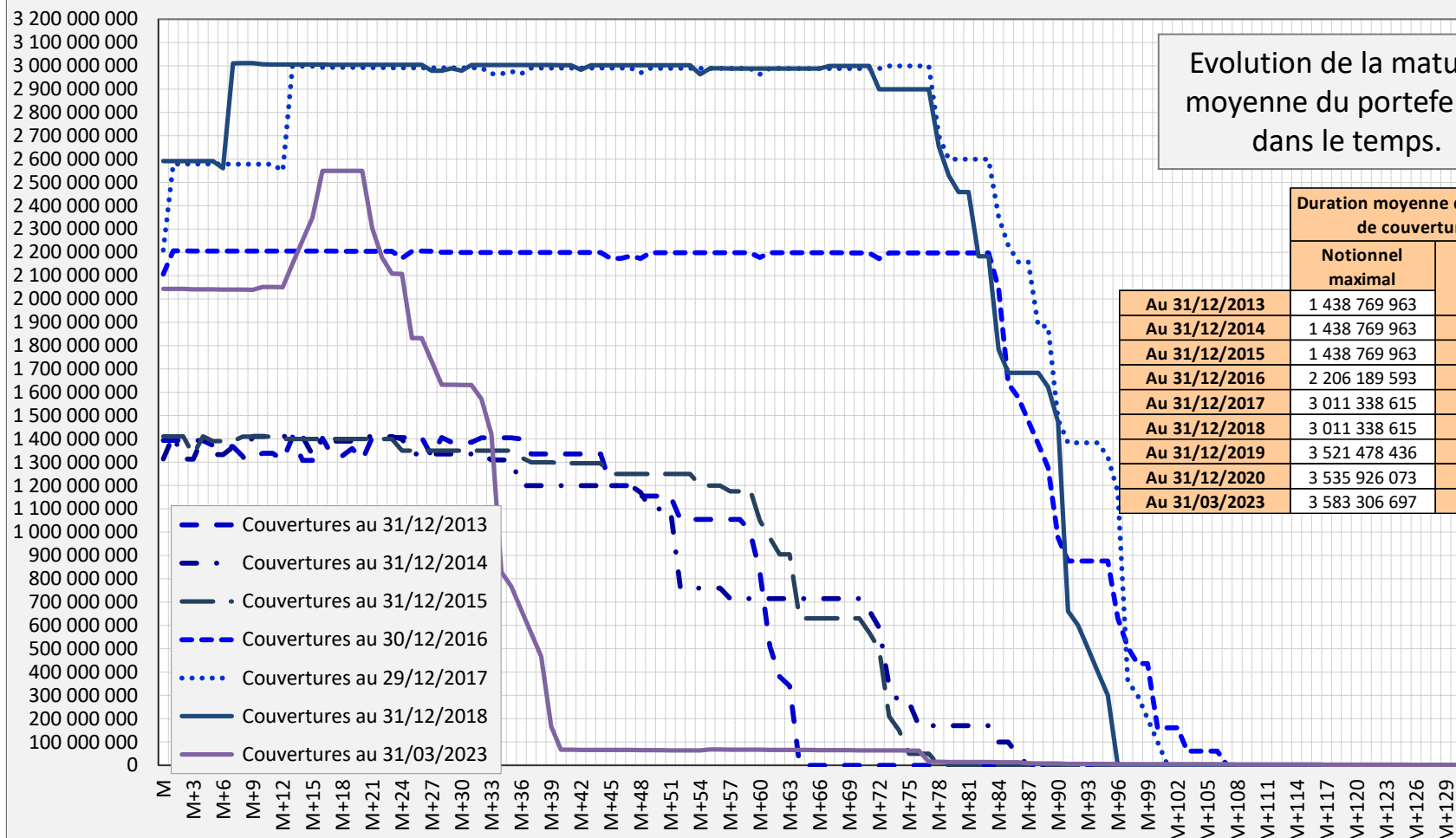


EUR

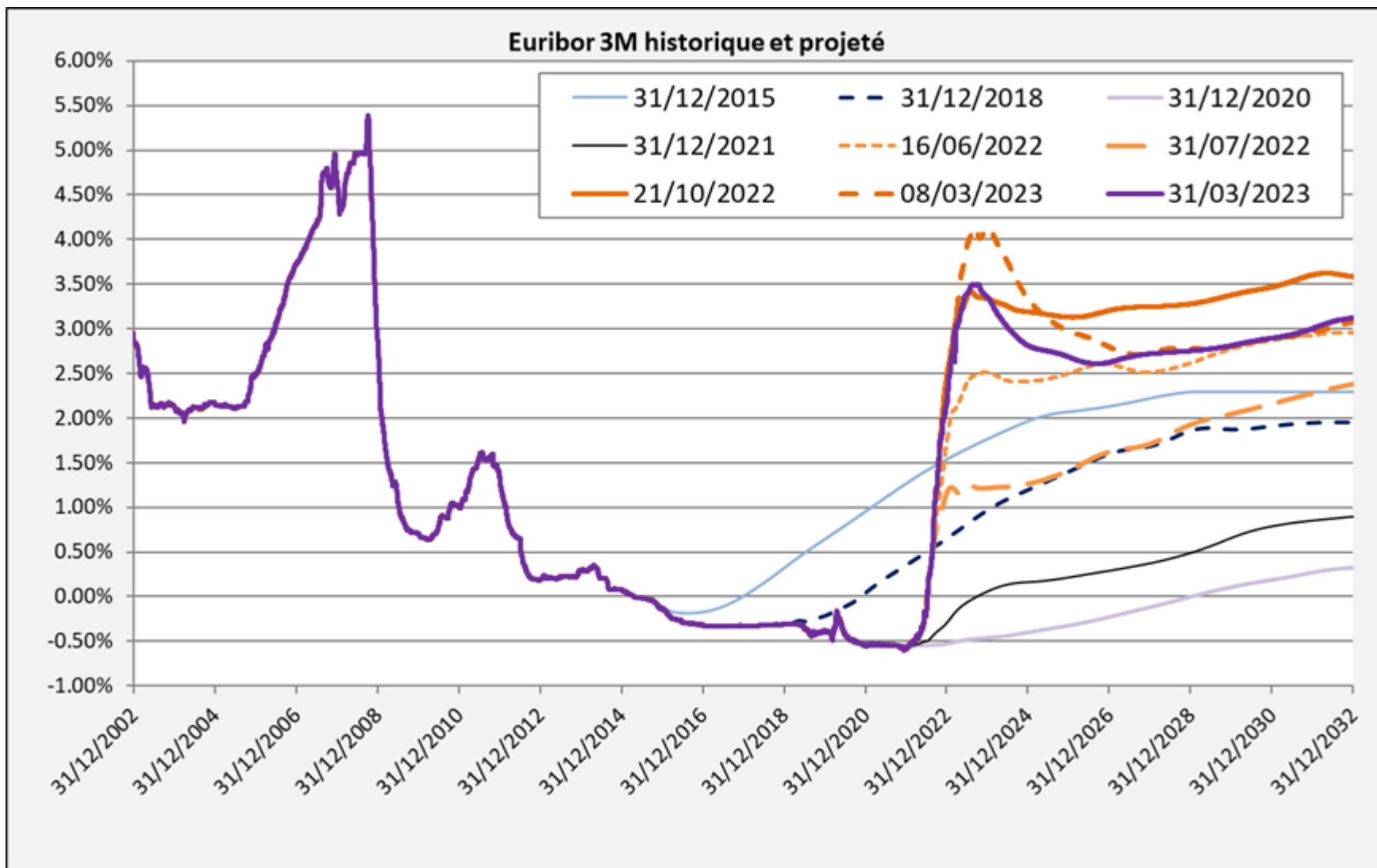
Cartographie historique des couvertures par date (total - synthèse vs clôtures)



Cartographie des couvertures (EUR) - "Base glissante"



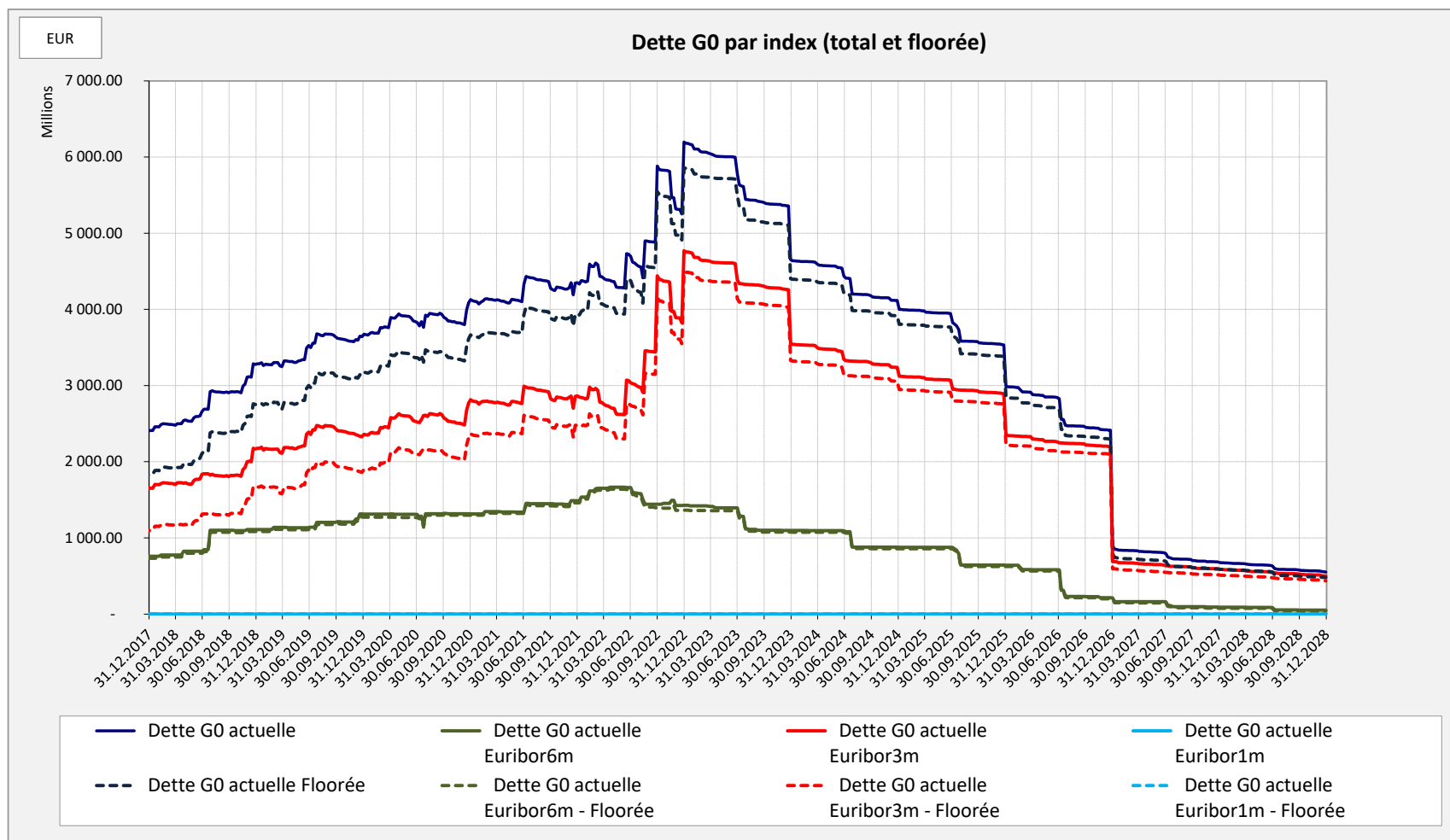
Annexes

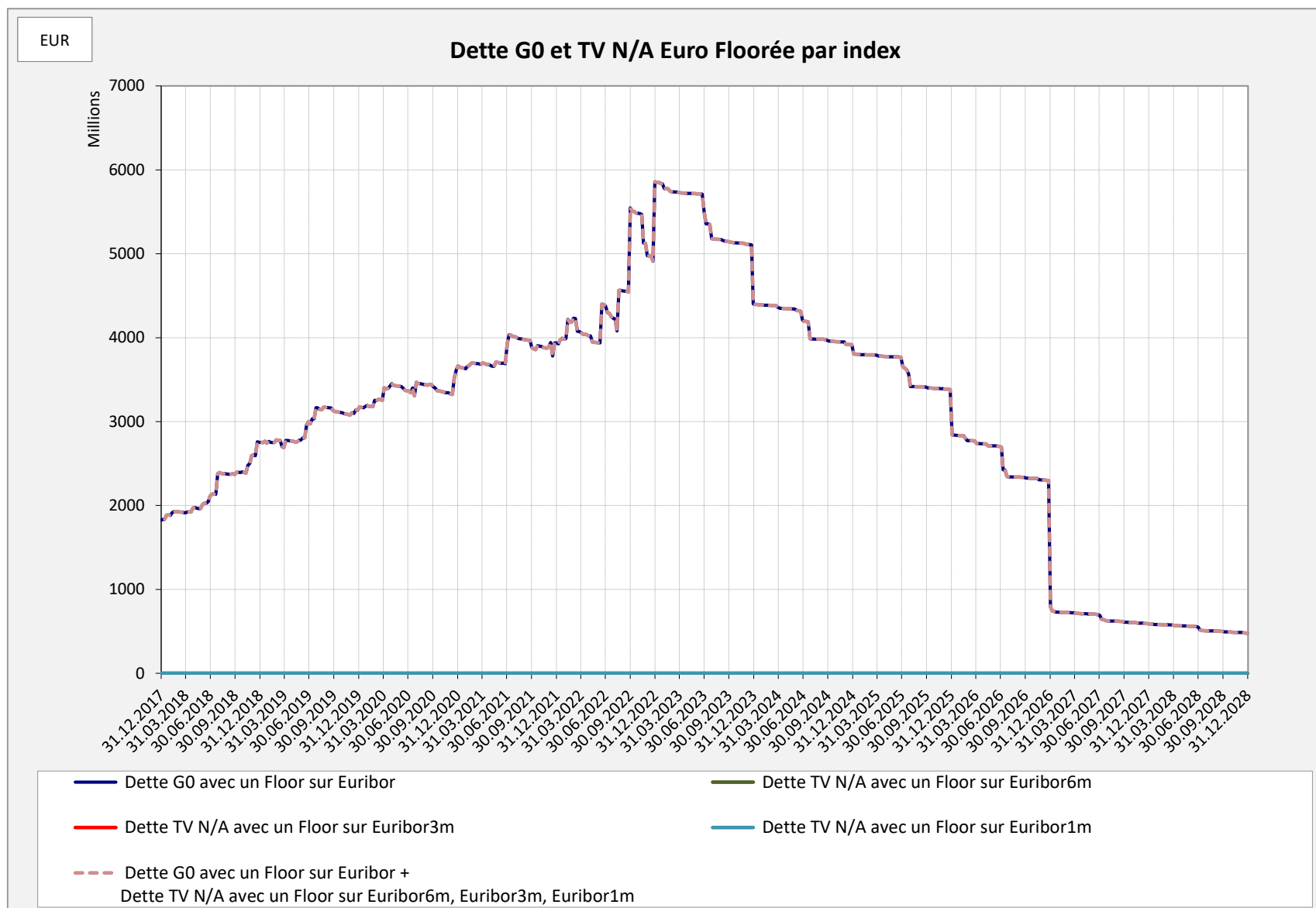


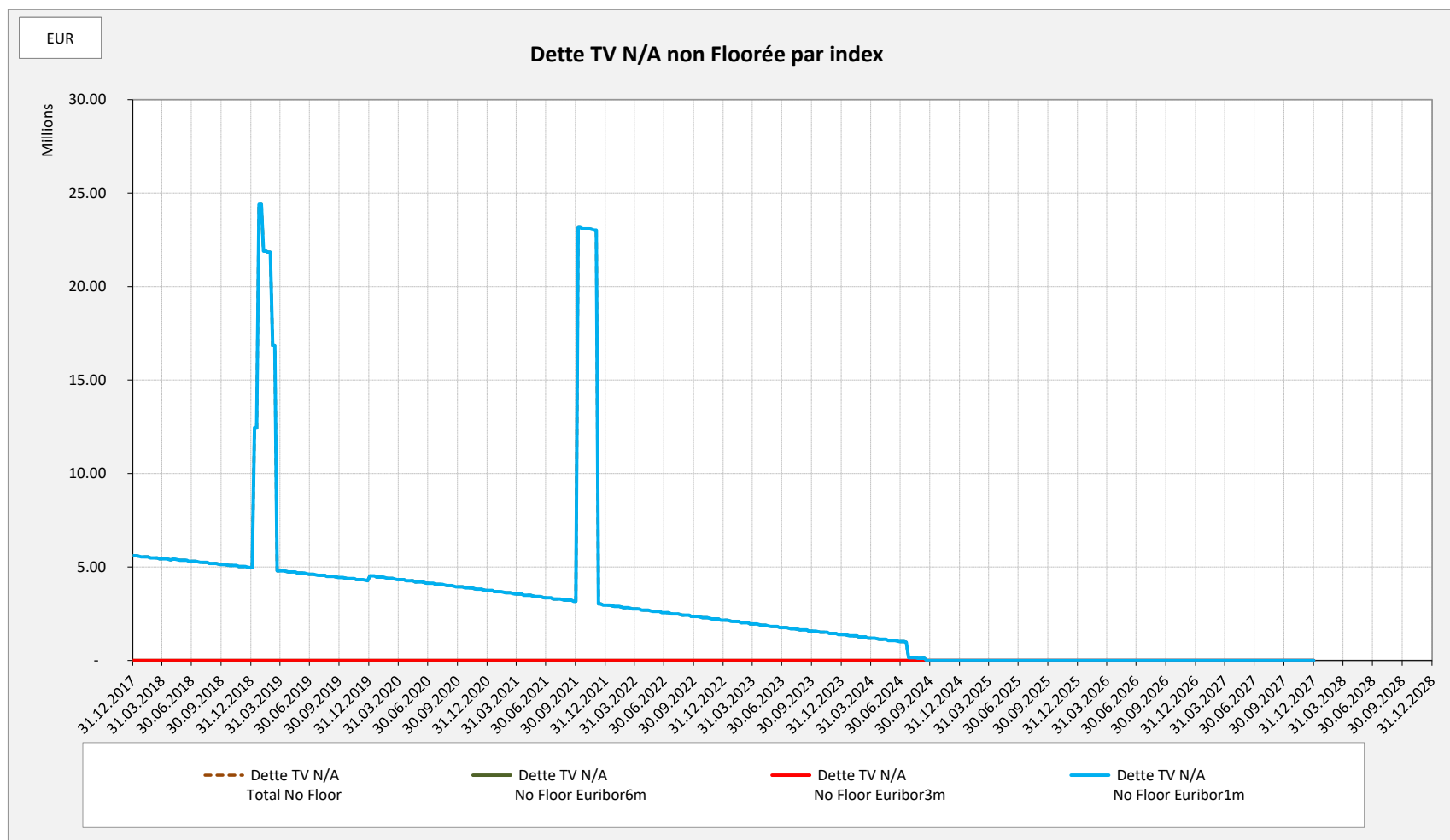
Données au 31 mars 2023

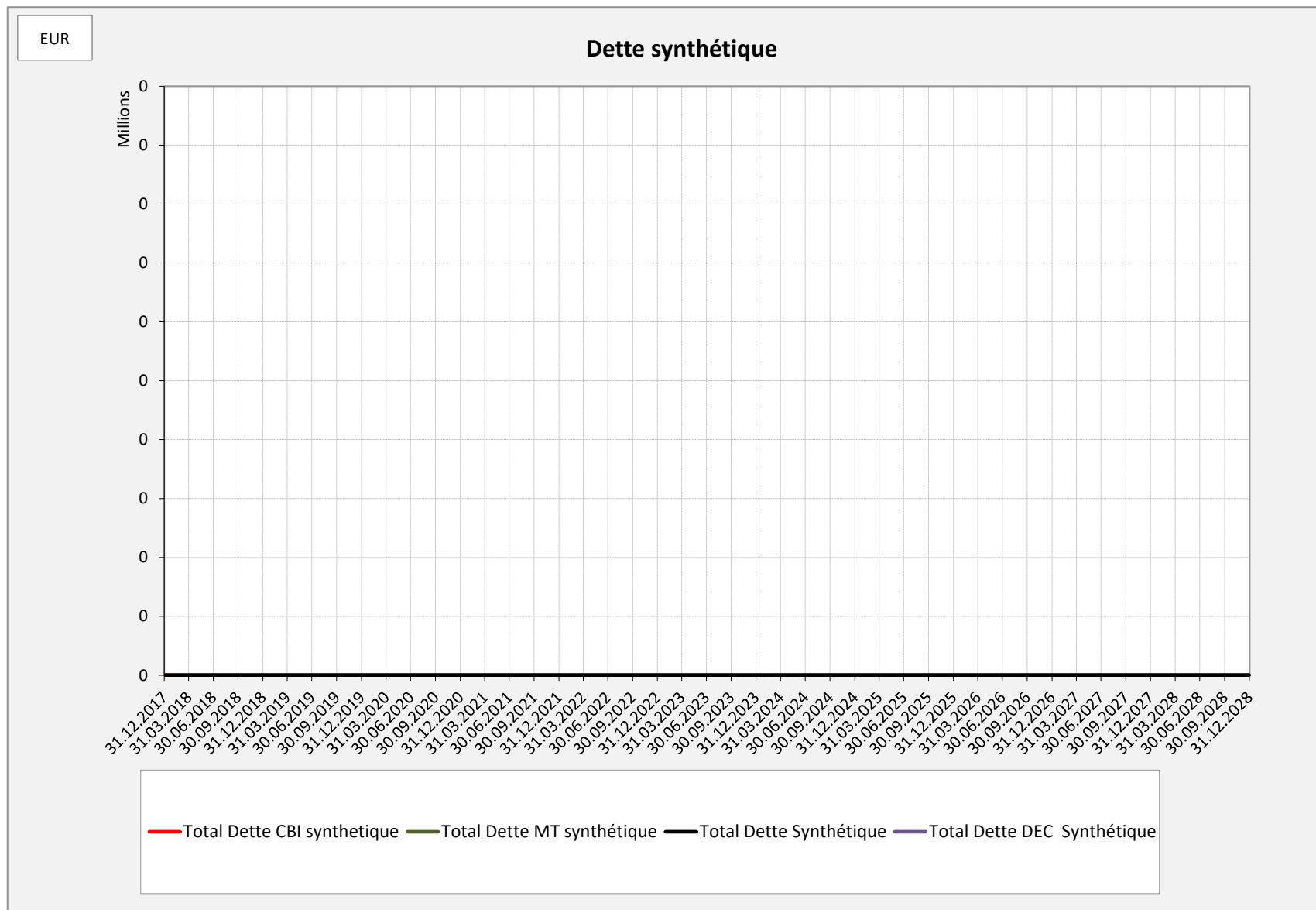
Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade Date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Payment Frequency	Currency	Amortizing	Rate	Floor	Initial notional
10083-F-LEASING	Location_Genefim	LEASING	22-Jul-09	22-Jul-09	22-Jul-24	END		EUR	VRAI	EURIBOR1M		5 467 319.87
10084-F-LEASING	Location_Genefim	LEASING	16-Jul-09	16-Jul-09	16-Jul-24	END		EUR	VRAI	EURIBOR1M	Floor	6 113 330.10
11142-F-CreditFoncierde	Emprunt_Credit Foncier de France	Credit Foncier de France	10-Dec-09	30-May-15	30-Nov-26	END		EUR	VRAI			3 830 229.53
11205-F-CreditFoncierde	Emprunt_Credit Foncier de France	Credit Foncier de France	30-Mar-13	31-Dec-14	30-Mar-45	END		EUR	VRAI			3 500 000.00
11494-F-RLBVorarlberg	Emprunt_RLB Vorarlberg	RLB Vorarlberg	09-Jul-07	01-Dec-15	01-Jun-39	END		EUR	FAUX			6 031 927.86
11599-F-RLBKärnten	Emprunt_RLB Kärnten	RLB Kärnten	25-Jan-18	31-Jan-18	31-Jan-38	END		EUR	FAUX			1 537 177.48
11600-F-RLBKärnten	Emprunt_RLB Kärnten	RLB Kärnten	25-Jan-18	25-Jan-18	31-Jan-38	END		EUR	FAUX			1 722 822.52
11611-F-Liberbank	Emprunt_Liberbank	Liberbank	03-Jul-18	03-Jul-18	21-Apr-34	END		EUR	VRAI	EURIBOR12M		7 385 784.00
11652-F-Bankinter	Emprunt_Bankinter	Bankinter	03-Jul-18	03-Jul-18	18-Mar-25	END		EUR	VRAI	EURIBOR12M		4 705 059.65
11670-F-LEASING	Location_Genefim	LEASING	18-Sep-09	18-Sep-09	18-Sep-24	END		EUR	VRAI	EURIBOR1M		5 067 041.14
11672-F-RLBVorarlberg	Emprunt_RLB Vorarlberg	RLB Vorarlberg	19-Oct-10	31-Dec-15	01-Jul-40	END		EUR	FAUX			2 468 712.57
11679-F-RBHohenems	Emprunt_RB Hohenems	RB Hohenems	11-May-05	01-Jan-16	30-Dec-24	END		EUR	FAUX			1 731 821.51
11807-F-KaerntnerSparka	Emprunt_Kaerntner Sparkasse	Kaerntner Sparkasse	06-Oct-17	06-Oct-17	30-Sep-30	END		EUR	FAUX			6 071 872.38
11813-F-RBBadRadkersbur	Emprunt_RB Bad Radkersburg	RB Bad Radkersburg	04-Oct-17	04-Oct-17	01-Mar-31	END		EUR	FAUX			5 010 555.46
11819-F-KaerntnerSparka	Emprunt_Kaerntner Sparkasse	Kaerntner Sparkasse	06-Oct-17	06-Oct-17	30-Sep-30	END		EUR	FAUX			1 699 512.70
11835-F-Oberbank	Emprunt_Oberbank	Oberbank	30-Sep-17	30-Sep-17	01-Mar-24	END		EUR	FAUX			748 568.43
11888-F-Sparkasse	Emprunt_Sparkasse	Sparkasse	03-Apr-17	31-Mar-18	30-Mar-27	END		EUR	VRAI	EURIBOR1M	Floor	830 769.21
11921-F-BancodoBrasil	Emprunt_Banco do Brasil	Banco do Brasil	15-Sep-20	18-Sep-20	18-Sep-23	END		EUR	VRAI	EURIBOR12M	Floor	10 000 000.00
30610-F-Caixageral dedep	Emprunt_Caixa geral de depositos	Caixa geral de depositos	31-Mar-16	31-Dec-19	20-Apr-23	END		EUR	VRAI	EURIBOR1M		256 564.22
31013-F-BPI	Emprunt_BPI	BPI	08-Jun-21	30-Jul-21	31-Jul-25	END		EUR	FAUX			15 000 000.00
											Total EUR	89 179 068.63

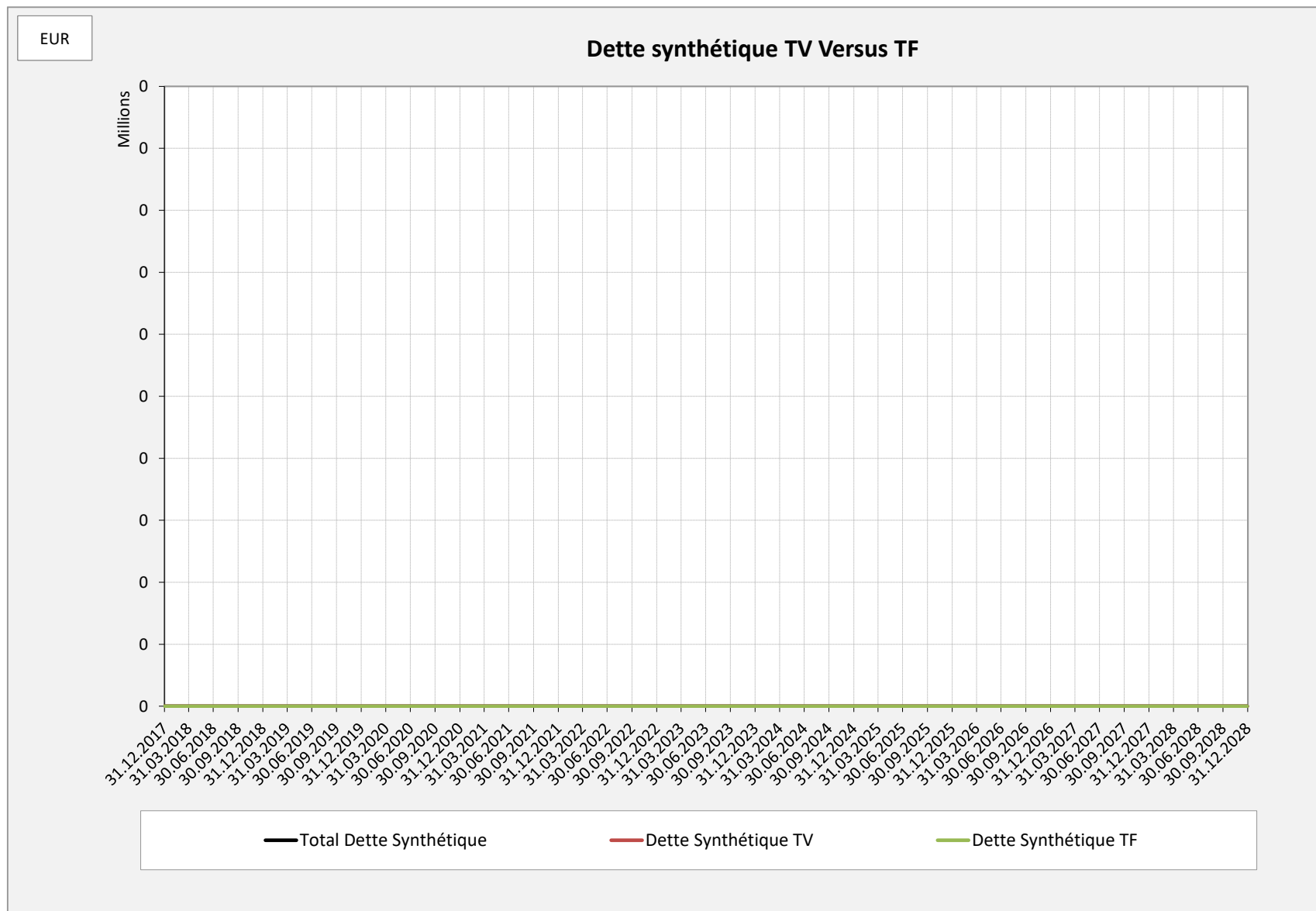
Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Tenor	Not CCY	Amortizing	Rate	Strike Rate	Floating Rate Margin	Initial Amount	Current Amount	Trade Type
-------------	-------------------	--------------	------------	----------------	---------------	----------------	-------	---------	------------	------	-------------	----------------------	----------------	----------------	------------











Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade Date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Payment Frequency	Currency	Amortizing	Rate	Initial notional	Current Amount
11183-F-MARKET	Valeur mobilière_MARKET	MARKET	28-Nov-12	04-Dec-12	04-Dec-26	END		EUR	FAUX	5.2500%	90 000 000.00	90 000 000.00
11197-F-LEASING	Location_SYNDICATED	LEASING	30-Jun-05	01-Oct-11	01-Jan-31	END		EUR	FAUX	4.0000%	1 115 344.12	537 829.55
11198-F-LEASING	Location_SYNDICATED	LEASING	30-Jun-05	01-Oct-11	01-Jan-31	END		EUR	FAUX	4.0000%	7 517 070.62	3 624 800.11
11199-F-LEASING	Location_SYNDICATED	LEASING	30-Jun-05	01-Oct-11	01-Jan-31	END		EUR	FAUX	4.0000%	4 035 813.43	1 946 106.22
11200-F-LEASING	Location_SYNDICATED	LEASING	30-Jun-05	01-Oct-11	01-Jan-31	END		EUR	FAUX	4.0000%	1 755 985.84	846 752.38
11201-F-LEASING	Location_SYNDICATED	LEASING	30-Jun-05	01-Jul-12	01-Jan-31	END		EUR	FAUX	4.0000%	2 000 000.00	1 046 557.75
11256-F-SYNDICATED	Emprunt_SYNDICATED	SYNDICATED	22-Jul-14	25-Jul-14	25-Jul-24	END		EUR	FAUX	4.1480%	6 500 000.00	6 500 000.00
11277-F-Siemens	Emprunt_Siemens	Siemens	13-Apr-15	17-Apr-15	01-Jul-23	END		EUR	FAUX	2.5090%	40 000 000.00	40 000 000.00
11310-F-BremerLandesban	Emprunt_Bremer Landesbank	Bremer Landesbank	01-Jun-15	01-Jun-15	31-Mar-25	END		EUR	FAUX	2.1500%	9 210 000.00	5 481 262.58
11311-F-BremerLandesban	Emprunt_Bremer Landesbank	Bremer Landesbank	01-Jun-15	01-Jun-15	31-Mar-25	END		EUR	FAUX	2.5500%	12 790 000.00	3 631 496.90
11312-F-MARKET	Valeur mobilière_MARKET	MARKET	22-Dec-15	22-Dec-15	01-Jul-23	END		EUR	FAUX	2.5680%	20 000 000.00	20 000 000.00
11313-F-MARKET	Valeur mobilière_MARKET	MARKET	22-Dec-15	22-Dec-15	22-Dec-25	END		EUR	FAUX	3.1440%	6 000 000.00	6 000 000.00
11352-F-SYNDICATED	Emprunt_SYNDICATED	SYNDICATED	30-Jun-16	05-Jul-16	05-Jul-23	END		EUR	FAUX	1.7790%	20 000 000.00	20 000 000.00
11354-F-BBVA	Emprunt_BBVA	BBVA	30-Jun-16	30-Jun-16	30-Jun-26	END		EUR	FAUX	1.7500%	4 500 000.00	1 549 647.74
11355-F-BBVA	Emprunt_BBVA	BBVA	30-Jun-16	30-Jun-16	30-Jun-26	END		EUR	FAUX	1.7500%	4 500 000.00	1 549 647.74
11356-F-LEASING	Location_BPCE lease	LEASING	19-May-16	27-May-16	27-May-30	END		EUR	FAUX	1.4000%	9 360 000.00	6 080 253.19
11362-F-LEASING	Location_KreditBank France	LEASING	30-Sep-15	07-Jun-16	07-Jun-23	END		EUR	FAUX	1.5700%	1 803 532.00	85 236.96
11363-F-LEASING	Location_Belfius	LEASING	20-May-16	20-May-16	20-May-23	END		EUR	FAUX	1.3500%	984 596.00	34 140.19
11364-F-LEASING	Location_Belfius	LEASING	16-Oct-15	20-May-16	20-May-23	END		EUR	FAUX	1.3500%	1 232 578.35	42 738.79
11387-F-SYNDICATED	Emprunt_SYNDICATED	SYNDICATED	14-Nov-16	18-Nov-16	18-Nov-23	END		EUR	FAUX	1.9170%	12 000 000.00	12 000 000.00
11396-F-BBVA	Emprunt_BBVA	BBVA	30-Dec-16	30-Dec-16	30-Dec-31	END		EUR	FAUX	1.8000%	37 880 000.00	23 327 556.73
11412-F-MARKET	Valeur mobilière_MARKET	MARKET	02-Mar-17	06-Mar-17	06-Mar-25	END		EUR	FAUX	2.3000%	50 000 000.00	50 000 000.00
11447-F-BBVA	Emprunt_BBVA	BBVA	27-Apr-17	27-Apr-17	27-Apr-32	END		EUR	FAUX	1.8000%	21 556 000.00	13 740 341.54
11451-F-LEASING	Location_IMPULS LEASING	LEASING	26-Apr-17	01-May-17	01-May-25	END		EUR	FAUX	2.6500%	250 458.65	75 178.58
11452-F-Bancosantander	Emprunt_Banco santander	Banco santander	28-Feb-17	28-Feb-17	28-Feb-29	END		EUR	FAUX	1.4000%	7 000 000.00	3 500 000.08
11458-F-CICNordOuest	Emprunt_CIC Nord Ouest	CIC Nord Ouest	30-Jan-12	01-Mar-17	20-Jan-24	END		EUR	FAUX	4.6000%	109 512.47	15 108.71
11459-F-CICNordOuest	Emprunt_CIC Nord Ouest	CIC Nord Ouest	27-Jan-12	01-Mar-17	20-Jan-24	END		EUR	FAUX	4.6000%	108 870.45	15 021.19
11466-F-Bundesumweltstift	Emprunt_Bundesumweltstiftung	Bundesumweltstiftung	30-Jun-17	05-Jul-17	05-Jul-27	END		EUR	FAUX	2.7930%	20 000 000.00	20 000 000.00
11477-F-MARKET	Valeur mobilière_MARKET	MARKET	22-Dec-15	22-Dec-15	22-Dec-25	END		EUR	FAUX	3.1440%	13 000 000.00	13 000 000.00
11488-F-TriodosBank	Emprunt_Triodos Bank	Triodos Bank	27-Mar-14	08-Nov-16	01-Nov-36	END		EUR	FAUX	2.1560%	12 150 000.00	8 897 545.22
11490-F-Bank für Sozialwirts	Emprunt_Bank für Sozialwirtschaft	Bank für Sozialwirtschaft	19-Apr-10	19-Apr-10	30-Jun-31	END		EUR	FAUX	5.2000%	12 000 000.00	6 588 857.85
11513-F-LEASING	Location_BBVA	LEASING	20-May-15	20-May-15	20-Jun-25	END		EUR	FAUX	2.0379%	5 745 785.67	1 369 569.06
11543-F-MARKET	Valeur mobilière_MARKET	MARKET	15-Dec-17	15-Dec-17	15-Dec-24	END		EUR	FAUX	2.2000%	63 000 000.00	63 000 000.00
11555-F-DiversInvestiss	Emprunt_Divers Investisseurs	Divers Investisseurs	08-Mar-18	08-Mar-18	10-Mar-25	END		EUR	FAUX	2.6250%	400 000 000.00	400 000 000.00
11565-F-BBVA	Emprunt_BBVA	BBVA	22-Dec-17	22-Dec-17	22-Dec-32	END		EUR	FAUX	1.8000%	4 854 000.00	3 301 855.99
11566-F-BBVA	Emprunt_BBVA	BBVA	22-Dec-17	22-Dec-17	22-Dec-32	END		EUR	FAUX	1.8000%	4 269 000.00	2 903 918.94
11567-F-BBVA	Emprunt_BBVA	BBVA	22-Dec-17	22-Dec-17	22-Dec-32	END		EUR	FAUX	1.8000%	3 297 000.00	2 242 731.42
11568-F-BBVA	Emprunt_BBVA	BBVA	25-Jan-18	25-Jan-18	25-Dec-24	END		EUR	FAUX	1.8000%	4 319 000.00	1 144 041.64
11593-F-TriodosBank	Emprunt_Triodos Bank	Triodos Bank	28-Jun-18	28-Jun-18	01-Apr-39	END		EUR	FAUX	2.2900%	10 000 000.00	8 455 489.64
11596-F-BNPParibasForti	Emprunt_BNP Paribas Fortis	BNP Paribas Fortis	05-Jun-18	15-Jun-18	15-Jun-23	END		EUR	FAUX	1.0950%	1 800 000.00	92 358.98
11602-F-SYNDICATED	Emprunt_SYNDICATED	SYNDICATED	25-Jul-18	25-Jul-18	25-Jul-24	END		EUR	FAUX	1.9000%	10 000 000.00	10 000 000.00
11604-F-SYNDICATED	Emprunt_SYNDICATED	SYNDICATED	25-Jul-18	25-Jul-18	25-Jul-25	END		EUR	FAUX	2.2290%	35 000 000.00	35 000 000.00
11605-F-SYNDICATED	Emprunt_SYNDICATED	SYNDICATED	25-Jul-18	25-Jul-18	25-Jul-23	END		EUR	FAUX	1.6630%	37 500 000.00	37 500 000.00
11621-F-BKSBankAG	Emprunt_BKS Bank AG	BKS Bank AG	02-Jul-18	02-Jul-18	01-Dec-27	END		EUR	FAUX		2 066 165.02	931 365.83
11631-F-BawagP.S.K.	Emprunt_Bawag P.S.K.	Bawag P.S.K.	20-Feb-19	26-Feb-19	26-Feb-24	END		EUR	FAUX	1.5270%	25 000 000.00	25 000 000.00
11682-F-LEASING	Location_SYNDICATED	LEASING	28-Dec-18	28-Dec-18	01-Jan-24	END		EUR	FAUX	1.3500%	27 185 277.15	4 659 194.75
11684-F-LEASING	Location_AUTRE	LEASING	12-Feb-16	01-Nov-16	01-Nov-36	END		EUR	FAUX	2.2150%	18 158 527.16	14 220 211.41
11686-F-LEASING	Location_Lease expansion	LEASING	01-Jul-18	01-Jul-18	01-Jul-23	END		EUR	FAUX	1.6596%	14 998 076.03	1 039 039.12

Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade Date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Payment Frequency	Currency	Amortizing	Rate	Initial notional	Current Amount
11687-F-LEASING	Location_Immorent-Anubis	LEASING	01-Jan-18	01-Jan-18	31-Dec-78	END		EUR	FAUX	6.0159%	4 079 141.85	4 035 513.53
11688-F-LEASING	Location_ISIS Raiffeisen- Immobilien - Leasing Gesellschaft m.b.H	LEASING	01-Jan-12	01-May-15	01-Jan-32	END		EUR	FAUX	2.0000%	14 302 039.42	9 064 449.90
11689-F-LEASING	Location_Raiffeisen	LEASING	01-Jul-09	01-Aug-15	01-Jul-29	END		EUR	FAUX	2.5000%	9 522 169.97	6 902 209.78
11690-F-LEASING	Location_Alba leasing	LEASING	30-Jun-17	30-Jun-17	31-Dec-31	END		EUR	FAUX	2.5003%	8 562 425.33	6 012 549.40
11691-F-LEASING	Location_Raiffeisen Impuls Leasing	LEASING	01-Jun-15	01-Jun-15	01-Oct-37	END		EUR	FAUX	4.4456%	7 796 037.66	5 949 363.70
11692-F-LEASING	Location_Evernex	LEASING	28-Dec-18	28-Dec-18	01-Jan-24	END		EUR	FAUX	1.3455%	7 084 806.66	1 214 127.62
11693-F-LEASING	Location_Raiffeisen	LEASING	01-Feb-16	01-Feb-16	01-Oct-27	END		EUR	FAUX	1.9000%	6 376 288.31	4 532 310.47
11694-F-LEASING	Location_UBI Leasing	LEASING	01-Jun-17	01-Jun-17	15-Oct-23	END		EUR	FAUX	4.5133%	6 473 414.42	3 378 784.27
11695-F-LEASING	Location_Raiffeisen	LEASING	01-Dec-12	01-Apr-16	01-Dec-32	END		EUR	FAUX	2.3333%	7 110 460.00	4 143 677.75
11696-F-LEASING	Location_Raiffeisen Impuls Leasing	LEASING	01-Jul-16	01-Jul-16	01-Dec-39	END		EUR	FAUX	3.6000%	5 731 241.47	4 563 500.65
11698-F-Triadobank	Emprunt_Triadobank	Triadobank	28-Jun-18	28-Jun-18	01-Jul-24	END		EUR	FAUX	1.3500%	4 750 000.00	4 750 000.00
11699-F-RLBSteiermark	Emprunt_RLB Steiermark	RLB Steiermark	30-Jun-16	30-Sep-16	30-Sep-23	END		EUR	FAUX	2.4800%	7 280 000.00	520 000.00
11700-F-LEASING	Location_BBVA	LEASING	20-May-15	20-May-15	20-Jun-25	END		EUR	FAUX	2.0033%	6 616 082.87	1 577 014.12
11701-F-LEASING	Location_Banque Postale	LEASING	01-Jul-18	01-Jul-18	01-Jul-23	END		EUR	FAUX	0.9499%	4 696 829.43	363 874.23
11702-F-LEASING	Location_Raiffeisen	LEASING	01-Jul-14	01-May-16	01-Jul-34	END		EUR	FAUX	2.5000%	4 721 789.01	2 715 757.80
11704-F-LEASING	Location_Leasecom	LEASING	01-Jul-18	01-Jul-18	01-Jul-23	END		EUR	FAUX	1.6700%	4 009 393.32	452 071.97
11705-F-LEASING	Location_ISIS Raiffeisen- Immobilien - Leasing Gesellschaft m.b.H	LEASING	01-Oct-11	01-Apr-13	01-Oct-31	END		EUR	FAUX	3.2909%	3 802 395.46	2 235 575.95
11706-F-LEASING	Location_ISIS Raiffeisen- Immobilien - Leasing Gesellschaft m.b.H	LEASING	01-Aug-15	01-Aug-15	01-Oct-31	END		EUR	FAUX	2.3000%	3 439 218.53	2 152 476.43
11707-F-LEASING	Location_Raiffeisen Impuls Leasing	LEASING	01-Jul-16	01-Jul-16	01-Dec-39	END		EUR	FAUX	0.0000%	3 190 076.02	2 281 859.22
11708-F-LEASING	Location_ISIS Raiffeisen- Immobilien - Leasing Gesellschaft m.b.H	LEASING	01-Jan-12	01-May-15	01-Jan-32	END		EUR	FAUX	2.0000%	3 045 744.00	2 102 487.16
11709-F-LEASING	Location_ISIS Raiffeisen- Immobilien - Leasing Gesellschaft m.b.H	LEASING	01-Jan-12	01-Jan-12	01-Jan-32	END		EUR	FAUX	1.9967%	3 398 518.22	2 036 679.49
11711-F-LEASING	Location_ISIS Raiffeisen- Immobilien - Leasing Gesellschaft m.b.H	LEASING	01-Jan-12	01-May-15	01-Jan-32	END		EUR	FAUX	2.0000%	3 040 488.23	1 913 603.51
11715-F-LEASING	Location_BBVA	LEASING	20-May-15	20-May-15	20-Jun-25	END		EUR	FAUX	2.0379%	3 562 478.05	849 154.74
11716-F-LEASING	Location_Raiffeisen Impuls Leasing	LEASING	01-Oct-14	01-Oct-14	01-Oct-37	END		EUR	FAUX	0.0000%	2 758 551.00	1 749 081.25
11719-F-LEASING	Location_ISIS Raiffeisen- Immobilien - Leasing Gesellschaft m.b.H	LEASING	01-Dec-12	01-Dec-12	01-Oct-31	END		EUR	FAUX	3.2779%	3 516 517.30	1 566 345.33
11720-F-LEASING	Location_BBVA	LEASING	20-May-15	20-May-15	20-Jun-25	END		EUR	FAUX	2.0379%	3 325 806.14	792 741.50
11721-F-LEASING	Location_ISIS Raiffeisen- Immobilien - Leasing Gesellschaft m.b.H	LEASING	01-Dec-12	01-Nov-13	01-Oct-31	END		EUR	FAUX	2.5944%	3 336 389.20	1 512 568.92
11722-F-LEASING	Location_ISIS Raiffeisen- Immobilien - Leasing Gesellschaft m.b.H	LEASING	01-Jan-12	01-May-15	01-Jan-32	END		EUR	FAUX	2.0000%	2 137 546.84	1 912 248.01
11723-F-BNPParibasForti	Emprunt_BNP Paribas Fortis	BNP Paribas Fortis	23-Mar-11	23-Mar-11	08-Apr-26	END		EUR	FAUX	4.7900%	3 360 000.00	902 749.77
11724-F-HypoLandesbankV	Emprunt_Hypo Landesbank Vorarlberg	Hypo Landesbank Vorarlberg	27-Apr-09	01-Oct-15	01-Jul-32	END		EUR	FAUX		1 942 149.43	1 179 202.36
11725-F-LEASING	Location_ISIS Raiffeisen- Immobilien - Leasing Gesellschaft m.b.H	LEASING	01-Jul-15	01-Jul-15	01-Jan-32	END		EUR	FAUX	2.3000%	2 226 935.80	1 400 397.53
11726-F-LEASING	Location_Bank Millennium SA	LEASING	15-Jun-18	15-Jun-18	15-May-30	END		EUR	FAUX	1.4000%	1 923 713.03	1 197 187.87
11728-F-LEASING	Location_Raiffeisen	LEASING	01-Feb-16	01-Feb-16	01-Feb-25	END		EUR	FAUX	1.9000%	2 601 095.89	611 829.58
11731-F-LEASING	Location_KBC	LEASING	15-Jul-16	15-Jul-16	15-Jul-23	END		EUR	FAUX	0.8200%	2 413 911.75	141 074.47
11734-F-CEBourgogneFran	Emprunt_CE Bourgogne Franche-Comté	CE Bourgogne Franche-Comté	19-May-09	19-Jun-09	05-Oct-27	END		EUR	FAUX	5.3000%	1 740 000.00	683 902.00
11744-F-MARKET	Valeur mobilière_MARKET	MARKET	17-May-19	17-May-19	17-May-27	END		EUR	FAUX	0.3750%	499 999 958.50	499 999 958.50
11750-F-LEASING	Location_IMPULS LEASING	LEASING	01-Jan-18	01-Jan-18	01-Jan-26	END		EUR	FAUX	2.6500%	1 089 219.04	420 135.71
11756-F-LEASING	Location_AUTRE	LEASING	01-Dec-10	01-Dec-10	01-Dec-30	END		EUR	FAUX	6.7031%	1 100 000.00	603 178.29
11764-F-BBVA	Emprunt_BBVA	BBVA	30-Apr-19	30-Apr-19	30-Apr-34	END		EUR	FAUX	2.0000%	5 600 000.00	4 295 616.33
11779-F-LEASING	Location_SYNDICATED	LEASING	27-Jun-19	01-Jul-19	01-Jul-24	END		EUR	FAUX	1.2541%	26 258 678.94	7 164 009.79
11780-F-LEASING	Location_Banque Postale	LEASING	21-Jun-19	01-Jul-19	01-Jul-24	END		EUR	FAUX	1.2000%	15 007 971.00	4 090 546.32
11781-F-LEASING	Location_Banque Postale	LEASING	21-Jun-19	01-Jul-19	01-Jul-24	END		EUR	FAUX	1.3001%	5 312 136.35	1 450 493.10
11791-F-LEASING	Location_AUTRE	LEASING	01-Apr-18	01-Apr-18	01-Jan-43	END		EUR	FAUX	2.0317%	9 077 041.55	7 619 837.25
11794-F-BancoBPM(ExBanc	Emprunt_Banco BPM (Ex Banco Popolare)	Banco BPM (Ex Banco Popolare)	30-Sep-16	01-Jan-19	30-Sep-31	END		EUR	FAUX	1.8000%	1 965 777.04	1 359 849.05
11796-F-SYNDICATED	Emprunt_SYNDICATED	SYNDICATED	16-Jul-19	22-Jul-19	22-Jul-24	END		EUR	FAUX	1.4000%	8 000 000.00	8 000 000.00
11799-F-SYNDICATED	Emprunt_SYNDICATED	SYNDICATED	16-Jul-19	22-Jul-19	22-Jul-26	END		EUR	FAUX	1.7000%	8 500 000.00	8 500 000.00
11801-F-AUTRE	Emprunt_AUTRE	AUTRE	30-Dec-18	30-Dec-18	31-Dec-80	END		EUR	FAUX	6.0000%	2 202 813.84	2 318 908.32
11808-F-AgriculturalBan	Emprunt_Agricultural Bank of China- Frankfurt Branch	Agricultural Bank of China- Frankfurt Branch	16-Jul-19	22-Jul-19	22-Jul-24	END		EUR	FAUX	1.4000%	4 500 000.00	4 500 000.00
11810-F-KaertntnerSparka	Emprunt_Kaertntner Sparkasse	Kaertntner Sparkasse	06-Oct-17	06-Oct-17	31-Oct-32	END		EUR	FAUX		1 441 230.35	967 672.94
11811-F-SYNDICATED	Emprunt_SYNDICATED	SYNDICATED	26-Jul-19	31-Jul-19	31-Jul-31	END		EUR	FAUX	2.5000%	50 000 000.00	50 000 000.00

Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade Date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Payment Frequency	Currency	Amortizing	Rate	Initial notional	Current Amount
11822-F-Oberbank	Emprunt_Oberbank	Oberbank	30-Sep-17	30-Sep-17	15-Sep-28	END		EUR	FAUX		1 160 729.32	602 688.24
11824-F-OHTKredit	Emprunt_OHT Kredit	OHT Kredit	30-Apr-08	30-Apr-08	30-Apr-24	END		EUR	FAUX	4.5000%	2 000 000.00	258 000.00
11832-F-TaunusSparkasse	Emprunt_Taunus Sparkasse	Taunus Sparkasse	30-Mar-18	30-Mar-18	30-Mar-26	END		EUR	FAUX	3.7500%	816 261.46	406 923.37
11833-F-Bankfürsozialwi	Emprunt_Bank für sozialwirtschaft	Bank für sozialwirtschaft	24-Jun-13	30-Mar-18	30-Mar-26	END		EUR	FAUX	3.7500%	816 261.46	406 923.37
11836-F-LEASING	Location_AUTRE	LEASING	12-May-06	01-Mar-08	01-Mar-33	END		EUR	FAUX	5.6764%	750 000.00	428 235.21
11837-F-LEASING	Location_AUTRE	LEASING	20-Nov-06	01-Jul-08	01-Jul-33	END		EUR	FAUX	5.6000%	723 200.00	421 466.71
11843-F-Sparkasse	Emprunt_Sparkasse	Sparkasse	30-Jun-19	30-Jun-19	30-Jun-23	END		EUR	FAUX	3.9800%	7 568 255.18	5 933 583.94
11854-F-BBVA	Emprunt_BBVA	BBVA	18-Nov-19	18-Nov-19	18-Nov-34	END		EUR	FAUX	2.0000%	5 199 717.30	4 277 336.99
11870-F-HypoLandesbankV	Emprunt_Hypo Landesbank Vorarlberg	Hypo Landesbank Vorarlberg	22-Jan-20	28-Feb-20	30-Jun-33	END		EUR	FAUX	1.1220%	2 150 000.00	1 672 220.00
11872-F-SYNDICATED	Emprunt_SYNDICATED	SYNDICATED	14-Apr-20	20-Apr-20	20-Apr-35	END		EUR	FAUX	2.8500%	40 000 000.00	40 000 000.00
11891-F-LEASING	Location_SYNDICATED	LEASING	27-Dec-19	01-Jan-20	01-Jan-25	END		EUR	FAUX	1.2541%	22 693 726.63	8 486 630.71
11902-F-LEASING	Location_Starlease	LEASING	30-Dec-19	05-Feb-20	05-Jan-26	END		EUR	FAUX	0.6905%	2 372 166.08	1 160 299.82
11910-F-DeutscheApothek	Emprunt_Deutsche Apotheker & Ärztebank	Deutsche Apotheker & Ärztebank	24-Jul-20	30-Jul-20	30-Jul-27	END		EUR	FAUX	2.2000%	10 000 000.00	10 000 000.00
11925-F-Bancosantander	Emprunt_Banco santander	Banco santander	29-Sep-20	01-Oct-20	29-Sep-23	END		EUR	FAUX	2.0000%	2 000 000.00	507 518.48
11926-F-SYNDICATED	Emprunt_SYNDICATED	SYNDICATED	25-Nov-20	30-Nov-20	30-Nov-27	END		EUR	FAUX	2.5640%	77 000 000.00	77 000 000.00
11933-F-SYNDICATED	Emprunt_SYNDICATED	SYNDICATED	16-Dec-20	18-Dec-20	18-Dec-28	END		EUR	FAUX	2.7700%	60 000 000.00	60 000 000.00
11934-F-EIFFEL	Emprunt_EIFFEL	EIFFEL	16-Dec-20	18-Dec-20	18-Dec-30	END		EUR	FAUX	3.0700%	15 000 000.00	15 000 000.00
11954-F-OLBBank	Emprunt_OLB Bank	OLB Bank	19-Apr-21	27-Apr-21	30-Jun-28	END		EUR	FAUX	2.2000%	20 000 000.00	20 000 000.00
11955-F-DiversInvestiss	Emprunt_Divers Investisseurs	Divers Investisseurs	30-Mar-21	01-Apr-21	01-Apr-28	END		EUR	FAUX	2.0000%	500 000 000.00	500 000 000.00
30322-F-BKSBankAG	Emprunt_BKS Bank AG	BKS Bank AG	01-Nov-19	01-Nov-19	01-Jan-29	END		EUR	FAUX	2.3500%	751 919.13	497 017.12
30332-F-RBStrass	Emprunt_RB Strass	RB Strass	01-Oct-17	01-Oct-17	15-Jun-30	END		EUR	FAUX		139 399.36	84 451.40
30445-F-BNPPParibasForti	Emprunt_BNP Paribas Fortis	BNP Paribas Fortis	05-Jun-18	15-Jun-18	15-Jun-23	END		EUR	FAUX	1.0949%	332 000.00	17 034.98
30446-F-BNPPParibasForti	Emprunt_BNP Paribas Fortis	BNP Paribas Fortis	05-Jun-18	15-Jun-18	15-Jun-23	END		EUR	FAUX	1.0949%	80 000.00	4 104.86
30448-F-BNPPParibasForti	Emprunt_BNP Paribas Fortis	BNP Paribas Fortis	05-Jun-18	15-Jun-18	15-Jun-23	END		EUR	FAUX	1.0949%	224 000.00	11 493.40
30449-F-BNPPParibasForti	Emprunt_BNP Paribas Fortis	BNP Paribas Fortis	05-Jun-18	15-Jun-18	15-Jun-23	END		EUR	FAUX	1.0949%	205 000.00	10 518.60
30612-F-KFW	Emprunt_KFW	KFW	30-Nov-16	01-Jan-19	31-Oct-23	END		EUR	FAUX	0.7500%	135 028.91	15 913.86
30722-F-Bankfürsozialwi	Emprunt_Bank für sozialwirtschaft	Bank für sozialwirtschaft	31-Dec-19	31-Dec-19	17-Apr-23	END		EUR	FAUX	2.0000%	8 841.00	8 841.00
30724-F-Bankfürsozialwi	Emprunt_Bank für sozialwirtschaft	Bank für sozialwirtschaft	31-Dec-19	31-Dec-19	17-Apr-23	END		EUR	FAUX	2.0000%	35 325.00	35 325.00
30726-F-Bankfürsozialwi	Emprunt_Bank für sozialwirtschaft	Bank für sozialwirtschaft	31-Dec-19	31-Dec-19	17-Apr-23	END		EUR	FAUX	2.0000%	60 858.00	60 858.00
30731-F-BPI	Emprunt_BPI	BPI	23-Mar-15	23-Dec-19	23-Mar-25	END		EUR	FAUX	2.0000%	113 918.69	44 823.47
30732-F-BPI	Emprunt_BPI	BPI	17-Dec-13	17-Dec-19	17-Dec-23	END		EUR	FAUX	1.8720%	114 241.64	22 171.05
30873-F-CAToulouse31	Emprunt_CA Toulouse 31	CA Toulouse 31	04-Sep-16	17-Jul-20	05-Sep-24	END		EUR	FAUX	1.2000%	243 603.18	89 102.67
30874-F-CAToulouse31	Emprunt_CA Toulouse 31	CA Toulouse 31	06-Mar-18	17-Jul-20	05-Mar-25	END		EUR	FAUX	1.0000%	142 075.04	61 701.66
30880-F-CANorddeFrance	Emprunt_CA Nord de France	CA Nord de France	16-Oct-19	16-Jul-20	10-May-25	END		EUR	FAUX	0.6500%	137 685.32	63 547.44
30885-F-BNPPPARIBAS	Emprunt_BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	14-Jun-16	16-Jul-20	10-Dec-23	END		EUR	FAUX	1.5000%	41 085.36	9 494.33
30908-F-Facilité -	Facilité_		07-May-20	07-May-20	08-May-23	END		EUR	FAUX			127 900 000.00
30910-F-LEASING	Location_Banque Postale	LEASING	19-Jun-20	01-Jul-20	01-Jul-25	END		EUR	FAUX	0.6167%	25 014 699.99	11 590 787.25
30911-F-LEASING	Location_Lixxbail	LEASING	19-Jun-20	01-Jul-20	01-Jul-25	END		EUR	FAUX	1.1501%	10 000 000.00	4 738 242.79
30912-F-LEASING	Location_SYNDICATED	LEASING	23-Jun-20	01-Jul-20	01-Jul-25	END		EUR	FAUX	1.5047%	12 263 313.98	5 837 716.87
30913-F-LEASING	Location_CCLS	LEASING	10-Dec-20	01-Jan-21	01-Jan-26	END		EUR	FAUX	1.1500%	11 636 106.83	6 675 792.65
30915-F-LEASING	Location_Lixxbail	LEASING	10-Dec-20	01-Jan-21	01-Jan-26	END		EUR	FAUX	1.1502%	8 195 046.11	4 701 617.86
30916-F-LEASING	Location_Banque Postale	LEASING	15-Dec-20	01-Jan-21	01-Jan-26	END		EUR	FAUX	1.1501%	5 070 167.87	2 908 827.83
30918-F-LEASING	Location_Sogelease	LEASING	21-Dec-20	21-Dec-20	21-Dec-25	END		EUR	FAUX	1.1499%	9 756 202.71	5 478 433.11
30920-F-LEASING	Location_Starlease	LEASING	28-Dec-20	01-Jan-21	31-Dec-26	END		EUR	FAUX	0.6609%	3 414 260.36	2 162 393.27
30927-F-LEASING	Location_Caisse d'épargne Lease	LEASING	11-Sep-19	12-Jul-20	12-Mar-27	END		EUR	FAUX	1.8700%	126 657.00	81 256.41
30928-F-LEASING	Location_Caisse d'épargne Lease	LEASING	17-Oct-19	16-Jul-20	17-Apr-25	END		EUR	FAUX	1.8262%	27 332.50	13 096.32
30929-F-LEASING	Location_Caisse d'épargne Lease	LEASING	13-Sep-19	13-Jul-20	13-Mar-27	END		EUR	FAUX	1.8900%	558 738.25	358 455.88
30930-F-LEASING	Location_Caisse d'épargne Lease	LEASING	19-Aug-19	19-Jul-20	19-Feb-24	END		EUR	FAUX	1.9200%	47 649.84	13 820.79

Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade Date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Payment Frequency	Currency	Amortizing	Rate	Initial notional	Current Amount
30935-F-LEASING	Location_BPCE lease	LEASING	18-Aug-17	18-Jul-20	18-Feb-24	END		EUR	FAUX	1.8000%	16 237.02	5 308.37
30936-F-LEASING	Location_CA Leasing	LEASING	15-Jul-20	15-Jul-20	15-Aug-24	END		EUR	FAUX	0.5600%	201 965.08	77 867.52
30937-F-LEASING	Location_CA Leasing	LEASING	24-Jul-20	24-Jul-20	24-Jul-24	END		EUR	FAUX	1.3600%	31 447.06	11 670.40
30938-F-LEASING	Location_CM-CIC lease	LEASING	12-Jul-20	12-Jul-20	12-Jul-23	END		EUR	FAUX	1.4200%	581 213.10	67 788.70
30939-F-LEASING	Location_Caisse d'épargne Lease	LEASING	23-Jul-20	23-Jul-20	23-Jun-27	END		EUR	FAUX	1.1300%	46 981.22	30 762.87
30940-F-LEASING	Location_CA Leasing	LEASING	19-Jul-20	19-Jul-20	19-Jul-25	END		EUR	FAUX	1.4400%	79 370.29	42 077.20
30941-F-LEASING	Location_CA Leasing	LEASING	19-Jul-20	19-Jul-20	19-Jul-25	END		EUR	FAUX	1.2200%	83 405.25	44 261.36
30942-F-LEASING	Location_CA Leasing	LEASING	26-Jul-20	26-Jul-20	26-Mar-25	END		EUR	FAUX	1.2200%	212 881.38	98 694.94
30945-F-LEASING	Location_Natiocredimurs	LEASING	07-Jul-20	07-Jul-20	07-Dec-23	END		EUR	FAUX	0.5300%	18 838.78	4 749.72
30949-F-LEASING	Location_BPCE lease	LEASING	16-Jan-18	16-Jul-20	16-Jul-23	END		EUR	FAUX	1.5500%	72 898.63	10 125.99
30950-F-LEASING	Location_BPCE lease	LEASING	16-Jan-18	16-Jul-20	16-Jul-23	END		EUR	FAUX	1.5500%	138 862.67	19 288.77
30951-F-LEASING	Location_SYNDICATED	LEASING	16-Jan-18	16-Jul-20	16-Jul-23	END		EUR	FAUX	1.5500%	209 405.13	29 313.68
30952-F-LEASING	Location_CIC Leasing	LEASING	18-Jun-20	18-Jul-20	18-Jun-27	END		EUR	FAUX	0.9722%	1 522 453.49	953 395.96
30953-F-LEASING	Location_CIC Leasing	LEASING	06-Jul-20	06-Jul-20	06-Jul-25	END		EUR	FAUX	1.2713%	28 535.76	13 692.35
30955-F-LEASING	Location_Lixxball	LEASING	18-Dec-19	18-Jul-20	17-Dec-24	END		EUR	FAUX	1.6031%	35 384.02	15 400.29
31011-F-DiversInvestiss	Emprunt_Divers Investisseurs	Divers Investisseurs	01-Jun-21	03-Jun-21	03-Jun-33	END		EUR	FAUX	2.7500%	60 000 000.00	60 000 000.00
31018-F-SYNDICATED	Emprunt_SYNDICATED	SYNDICATED	05-Jul-21	05-Jul-21	05-Jul-26	END		EUR	FAUX	1.4000%	12 000 000.00	12 000 000.00
31021-F-SYNDICATED	Emprunt_SYNDICATED	SYNDICATED	05-Jul-21	05-Jul-21	05-Jul-28	END		EUR	FAUX	1.7000%	48 000 000.00	48 000 000.00
31022-F-BanqueCourtois	Emprunt_Banque Courtois	Banque Courtois	07-Mar-18	16-Apr-21	05-Apr-23	END		EUR	FAUX	2.7600%	4 166.17	178.34
31024-F-SparkasseIngols	Emprunt_Sparkasse Ingolstadt Eichtätt	Sparkasse Ingolstadt Eichtätt	19-Nov-19	30-Sep-21	31-Dec-24	END		EUR	FAUX	2.0000%	800 000.00	800 000.00
31025-F-SparkasseIngols	Emprunt_Sparkasse Ingolstadt Eichtätt	Sparkasse Ingolstadt Eichtätt	07-Feb-19	30-Sep-21	30-Dec-28	END		EUR	FAUX	1.6000%	298 230.76	239 163.18
31027-F-UnicreditS.P.A	Emprunt_Unicredit S.P.A	Unicredit S.P.A	30-Jun-21	30-Jun-21	31-Jul-28	END		EUR	FAUX	3.3000%	529 828.63	413 250.27
31030-F-OHTKredit	Emprunt_OHT Kredit	OHT Kredit	30-Apr-09	30-Apr-21	30-Apr-25	END		EUR	FAUX	1.2000%	726 000.00	456 000.00
31031-F-OHTKredit	Emprunt_OHT Kredit	OHT Kredit	30-Sep-12	30-Apr-21	31-Mar-25	END		EUR	FAUX	2.2500%	1 000 000.00	500 000.00
31032-F-OHTKredit	Emprunt_OHT Kredit	OHT Kredit	30-Sep-14	30-Apr-21	31-Mar-27	END		EUR	FAUX	1.7500%	2 086 800.00	1 565 200.00
31036-F-VolksbankWien	Emprunt_Volksbank Wien	Volksbank Wien	01-Aug-19	30-Apr-21	30-Jun-27	END		EUR	FAUX	1.0000%	682 875.00	481 831.13
31040-F-CARDIFFRANCE	Emprunt_CARDIF FRANCE	CARDIF FRANCE	30-Jul-21	09-Aug-21	09-Aug-29	END		EUR	FAUX	2.0000%	48 000 000.00	48 000 000.00
31041-F-Bancosantander	Emprunt_Banco santander	Banco santander	30-Jun-21	08-Jul-21	30-Jun-26	END		EUR	FAUX	1.8000%	50 000 000.00	46 428 571.43
31065-F-SYNDICATED	Emprunt_SYNDICATED	SYNDICATED	12-Nov-21	18-Nov-21	18-Nov-26	END		EUR	FAUX	1.4000%	8 000 000.00	8 000 000.00
31067-F-RBI	Emprunt_RBI	RBI	12-Nov-21	18-Nov-21	17-Nov-28	END		EUR	FAUX	1.7400%	10 000 000.00	10 000 000.00
31068-F-GoldmanSachs	Emprunt_Goldman Sachs	Goldman Sachs	10-Nov-21	25-Nov-21	25-Nov-41	END		EUR	FAUX	3.0000%	37 500 000.00	37 500 000.00
31077-F-BNPParibasForti	Emprunt_BNP Paribas Fortis	BNP Paribas Fortis	15-Dec-21	24-Dec-21	05-Jan-34	END		EUR	FAUX	1.6900%	12 000 000.00	10 938 522.33
31078-F-OLBbank	Emprunt_OLB Bank	OLB Bank	03-Jan-22	03-Jan-22	30-Nov-26	END		EUR	FAUX	2.2000%	15 000 000.00	15 000 000.00
31086-F-Zagrebackabanka	Emprunt_Zagrebacka banka d.d	Zagrebacka banka d.d	31-Dec-22	31-Dec-22	01-Jul-25	END		EUR	FAUX	2.6000%	454 137.10	439 487.51
31104-F-DeutscheBankAG,	Emprunt_Deutsche Bank AG, London Branch	Deutsche Bank AG, London Branch	31-Dec-22	31-Dec-22	04-Dec-26	END		EUR	FAUX	5.2500%	1 202 142.75	1 217 920.87
31105-F-LEASING	Location_CM-CIC lease	LEASING	21-Jun-21	01-Jul-21	01-Jul-26	END		EUR	FAUX	1.1501%	15 016 676.76	10 106 713.09
31106-F-LEASING	Location_Franfinance Location	LEASING	21-Jun-21	01-Jul-21	01-Jul-26	END		EUR	FAUX	1.1502%	8 954 247.93	6 026 506.77
31107-F-LEASING	Location_La Banque Postale Leasing & Factoring	LEASING	21-Jun-21	01-Jul-21	01-Jul-26	END		EUR	FAUX	1.1498%	9 986 763.83	6 721 404.57
31108-F-LEASING	Location_Lixxball	LEASING	21-Jun-21	01-Jul-21	01-Jul-26	END		EUR	FAUX	1.1501%	13 965 943.61	9 399 531.64
31109-F-LEASING	Location_Starlease	LEASING	29-Jun-21	01-Jul-21	30-Jun-27	END		EUR	FAUX	0.6714%	1 579 667.24	1 130 004.85
31110-F-LEASING	Location_La Banque Postale Leasing & Factoring	LEASING	21-Dec-21	21-Dec-21	01-Jan-27	END		EUR	FAUX	1.1501%	12 390 391.72	9 562 673.08
31111-F-LEASING	Location_BECEM	LEASING	20-Dec-21	20-Dec-21	20-Dec-26	END		EUR	FAUX	1.0000%	2 000 000.00	1 509 331.48
31112-F-LEASING	Location_CIC Leasing	LEASING	20-Dec-21	20-Dec-21	20-Dec-26	END		EUR	FAUX	1.0000%	7 999 257.07	6 036 766.33
31113-F-LEASING	Location_Caisse d'épargne Lease	LEASING	22-Dec-21	22-Dec-21	22-Dec-26	END		EUR	FAUX	0.5000%	9 999 885.99	7 523 288.33
31114-F-LEASING	Location_Starlease	LEASING	31-Dec-21	14-Jan-22	31-Dec-27	END		EUR	FAUX	0.9000%	4 999 991.77	3 990 681.55
31115-F-LEASING	Location_Franfinance Location	LEASING	09-Jun-22	30-Jun-22	01-Jul-27	END		EUR	FAUX	4.6522%	9 030 634.02	7 944 188.66
31617-F-LEASING	Location_IMPULS Leasing	LEASING	01-Jul-16	01-Jul-16	01-Jul-24	END		EUR	FAUX	2.7502%	21 878.35	4 193.66
31621-F-LEASING	Location_ISIS Raiffeisen- Immobilien - Leasing Gesellschaft m.b.H	LEASING	01-Nov-13	01-Aug-15	01-Jan-32	END		EUR	FAUX	3.0000%	233 703.38	150 496.65

Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade Date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Payment Frequency	Currency	Amortizing	Rate	Initial notional	Current Amount
31640-F-LEASING	Location_AUTRE		28-Feb-14	31-May-14	01-May-24	END		EUR	FAUX	3.4093%	789 014.67	162 006.85
31644-F-LEASING	Location_AUTRE	LEASING	01-Jan-18	30-Dec-18	31-Dec-62	END		EUR	FAUX	5.7023%	36 058.46	35 046.27
31648-F-LEASING	Location_MKB Mittelrheinische Bank GmbH	LEASING	06-Apr-17	01-Jan-20	01-Apr-23	END		EUR	FAUX	6.1206%	20 371.31	572.96
31655-F-LEASING	Location_ABC Finance leasing	LEASING	01-Jan-17	01-Mar-18	01-Nov-24	END		EUR	FAUX	4.1800%	195 942.89	54 280.48
31659-F-LEASING	Location_HW Leasing	LEASING	01-Jan-21	15-Jan-21	15-Dec-26	END		EUR	FAUX	3.7103%	179 292.99	124 369.50
31660-F-LEASING	Location_HW Leasing	LEASING	01-Jul-21	01-Jul-21	01-Jun-27	END		EUR	FAUX	3.8020%	397 759.84	304 913.97
31662-F-LEASING	Location_Sozialverband VdK NRW e.V.	LEASING	20-Feb-14	31-Oct-21	31-Aug-23	END		EUR	FAUX	3.0000%	67 169.46	13 556.95
31669-F-LEASING	Location_IBERCAJA LEASING	LEASING	07-Jan-22	07-Jan-22	06-Jul-24	END		EUR	FAUX	2.1000%	41 349.42	22 952.85
31696-F-Facilité -	Facilité_		31-Mar-20	31-Dec-21	15-Apr-23	END		EUR	FAUX			252 971.00
31708-F-Facilité -	Facilité_		30-Sep-18	30-Sep-18	15-Apr-23	END		EUR	FAUX			3 900.00
31710-F-Facilité -	Facilité_		31-Mar-18	31-Mar-18	10-Mar-25	END		EUR	FAUX		-	512 955.44
31715-F-Facilité -	Facilité_		30-Jun-19	30-Jun-19	17-May-27	END		EUR	FAUX		-	41 133 596.00
31718-F-Facilité -	Facilité_		03-Jun-21	03-Jun-21	30-Jun-33	END		EUR	FAUX		-	26 101.57
31719-F-Facilité -	Facilité_		30-Dec-21	30-Dec-21	30-Jun-26	END		EUR	FAUX		-	1 050 493.15
31720-F-Facilité -	Facilité_		25-Nov-21	25-Nov-21	31-Dec-41	END		EUR	FAUX		-	1 520 172.84
31734-F-Facilité -	Facilité_		31-Dec-20	31-Dec-20	15-Apr-23	END		EUR	FAUX			5 000 000.00
31743-F-Facilité -	Facilité_		30-Jun-17	30-Jun-17	15-Oct-23	END		EUR	FAUX		-	1 001.60
31828-F-Facilité -	Facilité_		30-Jun-22	30-Jun-22	31-Dec-23	END		EUR	FAUX		-	2 799 497.00
31829-F-Facilité -	Facilité_		30-Jun-22	30-Jun-22	31-Dec-25	END		EUR	FAUX		-	5 866 092.00
31830-F-Facilité -	Facilité_		30-Jun-22	30-Jun-22	30-Jun-23	END		EUR	FAUX		-	745 940.00
31831-F-Facilité -	Facilité_		30-Sep-22	30-Sep-22	31-Dec-25	END		EUR	FAUX		-	2 373 027.00
31832-F-Facilité -	Facilité_		30-Sep-22	30-Sep-22	31-Dec-26	END		EUR	FAUX		-	16 654 068.00
31833-F-Facilité -	Facilité_		31-Mar-18	31-Mar-18	15-Feb-28	END		EUR	FAUX		-	907 485.41
31847-F-Facilité -	Facilité_		30-Sep-19	30-Sep-19	23-Dec-25	END		EUR	FAUX			199 087.54
31869-F-Facilité -	Facilité_		30-Jun-17	30-Jun-17	31-Dec-50	END		EUR	FAUX			35 000.00
50018-F-BBVA	Emprunt_BBVA	BBVA	30-Sep-17	30-Sep-17	30-Sep-32	END		EUR	FAUX	1.8000%	6 780 000.00	4 503 553.25
50019-F-BBVA	Emprunt_BBVA	BBVA	30-Sep-17	30-Sep-17	30-Sep-32	END		EUR	FAUX	1.8000%	4 077 000.00	2 708 110.42
50020-F-BBVA	Emprunt_BBVA	BBVA	29-Sep-17	30-Sep-17	30-Sep-32	END		EUR	FAUX	1.8000%	5 585 000.00	3 709 785.40
Total EUR											3 194 093 860.04	2 902 914 105.65

Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Tenor	Not CCY	Amortizing	Rate	Initial Amount	Current Amount
DEXI2-F	Emprunt 1.80ME Amort. 5.214% (Belgique)	DEXIA	39429	13-déc.-07	31-déc.-24	END	3m	EUR	VRAI	5.2140%	1,806,250.00	1,384,787.00
DEXI3-F	Emprunt 0.53ME Amort. 4.972% (Belgique)	DEXIA	39429	13-déc.-07	31-déc.-16	END	3m	EUR	VRAI	4.9720%	531,250.00	265,628.00
FORT11-F	Emprunt 3.61ME Amort. 4.20%	FORTIS	30-nov-04	31-déc.-06	31-déc.-21	END	1m	EUR	VRAI	4.2000%	3,610,000.00	2,243,909.25
BRES1-F	Emprunt 12M Amort. 5.67%	BRESCIA	39447	31-déc.-07	31-déc.-22	END	3m	EUR	VRAI	5.6700%	12,000,000.00	8,811,587.17
CONV1-F	Obligation convertible 180ME 3.875% OCEANE	OBLIG	15-déc-10	1-janv.-12	1-janv.-16	END	1y	EUR	FAUX	3.8750%	179,999,956.05	179,999,956.05
FINA8-F	Crédit-bail 21.5ME OSEO + Finamur	FINAMUR	23-déc-09	1-oct.-10	1-janv.-23	END	3m	EUR	FAUX	5.3500%	10,750,000.00	10,750,000.00
BNP12-F	Emprunt Le Jardin des Lys 2.2ME TF 4.05%	BNP	39447	31-déc.-07	31-déc.-17	END	1m	EUR	VRAI	4.0500%	2,234,000.00	1,079,587.39
OSEO16-F	CBI Brantôme 3.53ME Taux Fixe 4.27%	OSEO	39534	27-mars-08	27-déc.-19	END	3m	EUR	VRAI	4.2700%	3,535,358.00	2,309,632.77
OSEO17-F	CBI Brantôme 0.81ME Taux Fixe 4.27%	OSEO	39534	27-déc.-07	27-déc.-19	END	3m	EUR	VRAI	4.2700%	814,642.00	522,199.54
CADEP4-F	Empunt 2.4ME Taux fixe 4.15%	CAISSE D'EP	09-juin-10	30-juin-10	30-juin-19	END	3m	EUR	VRAI	4.1500%	2,400,000.00	1,940,538.54
DB1-F	Emprunt 20ME Taux fixe 5.00% (Schuldschein)	OBLIG	27-mars-12	30-mars-12	30-mars-17	END	3m	EUR	FAUX	5.0000%	20,000,000.00	20,000,000.00
BRES2-F	Crédit-bail 8.25ME Taux Fixe 3.64%	BRESCIA	01-oct-07	1-oct.-07	31-déc.-21	END	1y	EUR	FAUX	3.6384%	8,248,000.00	8,248,000.00
BRES3-F	Crédit-bail 9.99ME Taux Fixe 4.46%	BRESCIA	10-nov-06	14-nov.-06	14-nov.-21	END	1m	EUR	VRAI	4.4600%	9,996,000.00	6,947,977.99
BRES4-F	Crédit-bail 5ME Taux Fixe 4.39%	BRESCIA	06-juin-07	6-juin-07	31-déc.-21	END	1y	EUR	FAUX	4.3942%	5,005,000.00	5,005,000.00
KBC6-F	Emprunt 6.76ME Taux Fixe 5.92%	KBC	07-juil-07	30-juin-10	30-juin-28	END	3m	EUR	VRAI	5.9200%	6,758,000.00	6,117,572.96
KBC7-F	Emprunt 5.98ME Taux Fixe 5.92%	KBC	17-juil-07	1-janv.-09	31-mars-28	END	3m	EUR	VRAI	5.9200%	5,980,000.00	5,415,111.19
CADEP5-F	Emprunt 4.33ME Taux Fixe 3.30%	CAISSE D'EP	12-janv-11	12-janv.-11	1-févr.-26	END	1m	EUR	VRAI	3.3000%	4,330,000.00	3,728,214.81
CAGR10-F	Emprunt 23.1MFF Taux Fixe 6.20%	CA	12-janv-01	12-janv.-01	15-janv.-16	END	1m	EUR	VRAI	6.2000%	3,521,572.30	808,686.76
CADEP6-F	Emprunt 1.77ME Taux Fixe 4.40%	CAISSE D'EP	23-mai-07	5-juil.-06	5-juin-17	END	1m	EUR	VRAI	4.4000%	1,770,000.00	771,594.48
CAIB8-F	Emprunt obligataire Tranche A 65ME Taux Fixe 4.10%	CACIB	21-nov-12	30-nov.-12	10-janv.-18	END	1y	EUR	FAUX	4.1000%	65,000,000.00	65,000,000.00
CAIB8-F	Emprunt obligataire Tranche B 128ME Taux Fixe 4.60%	CACIB	41234	30-nov.-12	30-mai-19	END	1y	EUR	FAUX	4.6000%	128,000,000.00	128,000,000.00
DB4-F	Note 90ME Taux Fixe 5.25%	DB	04-déc-12	4-déc.-12	4-déc.-26	END	1y	EUR	FAUX	5.2500%	90,000,000.00	90,000,000.00
KEP1-F	Note 20ME Taux Fixe 4.20%	KEPLER	30-nov-12	30-nov.-12	30-nov.-18	END	1y	EUR	FAUX	4.2000%	20,000,000.00	20,000,000.00
DB4-F	Loan 10ME Taux fixe 5.25%	DB	41247	4-déc.-12	4-déc.-26	END	1y	EUR	FAUX	5.2500%	10,000,000.00	10,000,000.00
CEL1-F	Emprunt 20ME Taux Fixe 2,45%	CAISSE D'EP	15-mars-13	15-mars-13	15-mars-18	END	3m	EUR	VRAI	2.4500%	20,000,000.00	19,056,944.22
CAIB8-F	Emprunt Obligataire Tranche TAP 33ME Taux Fixe 4,60%	CACIB	41243	30-nov.-12	30-mai-19	END	1y	EUR	FAUX	4.6000%	33,000,000.00	33,000,000.00
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 1.08ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	1,082,542.03	1,171,636.22
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 7.30ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	7,295,994.68	7,896,461.91
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 3.92ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	3,917,120.75	4,239,503.83
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 7.30ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	7,295,994.68	7,896,461.91
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 1.70ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	1,704,342.55	1,844,611.53
ORNA1-F	Emprunt obligataire Ormane 198ME Taux Fixe 1,75%	NATIXIS	09-juil-13	17-juil.-13	1-janv.-20	END	1y	EUR	FAUX	1.7500%	198,374,979.36	198,374,979.36
DEGR1-F	Emprunt obligataire belge 55ME Taux Fixe 4%	DEGROOF	03-juil-13	3-juil.-13	31-déc.-18	END	1y	EUR	FAUX	4.0000%	55,000,000.00	55,000,000.00
DEGR2-F	Emprunt obligataire belge 20ME Taux Fixe 4,45%	DEGROOF	03-juil-13	3-juil.-13	31-déc.-20	END	1y	EUR	FAUX	4.4500%	20,000,000.00	20,000,000.00
KEP2-F	Emprunt obligataire 20ME Taux Fixe 4,15%	KEPLER	15-juil-13	15-juil.-13	30-nov.-19	END	1y	EUR	FAUX	4.1500%	20,000,000.00	20,000,000.00
											963,961,002.40	947,830,582.87

Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Tenor	Not CCY	Amortizing	Rate	Initial Amount	Current Amount
DEXI2-F	Emprunt 1.80ME Amort. 5.214% (Belgique)	DEXIA	39429	13-déc.-07	31-déc.-24	END	3m	EUR	VRAI	5.2140%	1,806,250.00	1,384,787.00
DEXI3-F	Emprunt 0.53ME Amort. 4.972% (Belgique)	DEXIA	39429	13-déc.-07	31-déc.-16	END	3m	EUR	VRAI	4.9720%	531,250.00	265,628.00
FORT11-F	Emprunt 3.61ME Amort. 4.20%	FORTIS	30-nov-04	31-déc.-06	31-déc.-21	END	1m	EUR	VRAI	4.2000%	3,610,000.00	2,243,909.25
BRES1-F	Emprunt 12M Amort. 5.67%	BRESCIA	39447	31-déc.-07	31-déc.-22	END	3m	EUR	VRAI	5.6700%	12,000,000.00	8,811,587.17
CONV1-F	Obligation convertible 180ME 3.875% OCEANE	OBLIG	15-déc-10	1-janv.-12	1-janv.-16	END	1y	EUR	FAUX	3.8750%	179,999,956.05	179,999,956.05
FINA8-F	Crédit-bail 21.5ME OSEO + Finamur	FINAMUR	23-déc-09	1-oct.-10	1-janv.-23	END	3m	EUR	FAUX	5.3500%	10,750,000.00	10,750,000.00
BNP12-F	Emprunt Le Jardin des Lys 2.2ME TF 4.05%	BNP	39447	31-déc.-07	31-déc.-17	END	1m	EUR	VRAI	4.0500%	2,234,000.00	1,079,587.39
OSEO16-F	CBI Brantôme 3.53ME Taux Fixe 4.27%	OSEO	39534	27-mars-08	27-déc.-19	END	3m	EUR	VRAI	4.2700%	3,535,358.00	2,309,632.77
OSEO17-F	CBI Brantôme 0.81ME Taux Fixe 4.27%	OSEO	39534	27-déc.-07	27-déc.-19	END	3m	EUR	VRAI	4.2700%	814,642.00	522,199.54
CADEP4-F	Empunt 2.4ME Taux fixe 4.15%	CAISSE D'EP	09-juin-10	30-juin-10	30-juin-19	END	3m	EUR	VRAI	4.1500%	2,400,000.00	1,940,538.54
DB1-F	Emprunt 20ME Taux fixe 5.00% (Schuldschein)	OBLIG	27-mars-12	30-mars-12	30-mars-17	END	3m	EUR	FAUX	5.0000%	20,000,000.00	20,000,000.00
BRES2-F	Crédit-bail 8.25ME Taux Fixe 3.64%	BRESCIA	01-oct-07	1-oct.-07	31-déc.-21	END	1y	EUR	FAUX	3.6384%	8,248,000.00	8,248,000.00
BRES3-F	Crédit-bail 9.99ME Taux Fixe 4.46%	BRESCIA	10-nov-06	14-nov.-06	14-nov.-21	END	1m	EUR	VRAI	4.4600%	9,996,000.00	6,947,977.99
BRES4-F	Crédit-bail 5ME Taux Fixe 4.39%	BRESCIA	06-juin-07	6-juin-07	31-déc.-21	END	1y	EUR	FAUX	4.3942%	5,005,000.00	5,005,000.00
KBC6-F	Emprunt 6.76ME Taux Fixe 5.92%	KBC	07-juil-07	30-juin-10	30-juin-28	END	3m	EUR	VRAI	5.9200%	6,758,000.00	6,117,572.96
KBC7-F	Emprunt 5.98ME Taux Fixe 5.92%	KBC	17-juil-07	1-janv.-09	31-mars-28	END	3m	EUR	VRAI	5.9200%	5,980,000.00	5,415,111.19
CADEP5-F	Emprunt 4.33ME Taux Fixe 3.30%	CAISSE D'EP	12-janv-11	12-janv.-11	1-févr.-26	END	1m	EUR	VRAI	3.3000%	4,330,000.00	3,728,214.81
CAGR10-F	Emprunt 23.1MFF Taux Fixe 6.20%	CA	12-janv-01	12-janv.-01	15-janv.-16	END	1m	EUR	VRAI	6.2000%	3,521,572.30	808,686.76
CADEP6-F	Emprunt 1.77ME Taux Fixe 4.40%	CAISSE D'EP	23-mai-07	5-juil.-06	5-juin-17	END	1m	EUR	VRAI	4.4000%	1,770,000.00	771,594.48
CAIB8-F	Emprunt obligataire Tranche A 65ME Taux Fixe 4.10%	CACIB	21-nov-12	30-nov.-12	10-janv.-18	END	1y	EUR	FAUX	4.1000%	65,000,000.00	65,000,000.00
CAIB8-F	Emprunt obligataire Tranche B 128ME Taux Fixe 4.60%	CACIB	41234	30-nov.-12	30-mai-19	END	1y	EUR	FAUX	4.6000%	128,000,000.00	128,000,000.00
DB4-F	Note 90ME Taux Fixe 5.25%	DB	04-déc-12	4-déc.-12	4-déc.-26	END	1y	EUR	FAUX	5.2500%	90,000,000.00	90,000,000.00
KEP1-F	Note 20ME Taux Fixe 4.20%	KEPLER	30-nov-12	30-nov.-12	30-nov.-18	END	1y	EUR	FAUX	4.2000%	20,000,000.00	20,000,000.00
DB4-F	Loan 10ME Taux fixe 5.25%	DB	41247	4-déc.-12	4-déc.-26	END	1y	EUR	FAUX	5.2500%	10,000,000.00	10,000,000.00
CEL1-F	Emprunt 20ME Taux Fixe 2,45%	CAISSE D'EP	15-mars-13	15-mars-13	15-mars-18	END	3m	EUR	VRAI	2.4500%	20,000,000.00	19,056,944.22
CAIB8-F	Emprunt Obligataire Tranche TAP 33ME Taux Fixe 4,60%	CACIB	41243	30-nov.-12	30-mai-19	END	1y	EUR	FAUX	4.6000%	33,000,000.00	33,000,000.00
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 1.08ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	1,082,542.03	1,171,636.22
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 7.30ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	7,295,994.68	7,896,461.91
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 3.92ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	3,917,120.75	4,239,503.83
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 7.30ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	7,295,994.68	7,896,461.91
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 1.70ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	1,704,342.55	1,844,611.53
ORNA1-F	Emprunt obligataire Ormane 198ME Taux Fixe 1,75%	NATIXIS	09-juil-13	17-juil.-13	1-janv.-20	END	1y	EUR	FAUX	1.7500%	198,374,979.36	198,374,979.36
DEGR1-F	Emprunt obligataire belge 55ME Taux Fixe 4%	DEGROOF	03-juil-13	3-juil.-13	31-déc.-18	END	1y	EUR	FAUX	4.0000%	55,000,000.00	55,000,000.00
DEGR2-F	Emprunt obligataire belge 20ME Taux Fixe 4,45%	DEGROOF	03-juil-13	3-juil.-13	31-déc.-20	END	1y	EUR	FAUX	4.4500%	20,000,000.00	20,000,000.00
KEP2-F	Emprunt obligataire 20ME Taux Fixe 4,15%	KEPLER	15-juil-13	15-juil.-13	30-nov.-19	END	1y	EUR	FAUX	4.1500%	20,000,000.00	20,000,000.00
											963,961,002.40	947,830,582.87

Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Tenor	Not CCY	Amortizing	Rate	Initial Amount	Current Amount
DEXI2-F	Emprunt 1.80ME Amort. 5.214% (Belgique)	DEXIA	39429	13-déc.-07	31-déc.-24	END	3m	EUR	VRAI	5.2140%	1,806,250.00	1,384,787.00
DEXI3-F	Emprunt 0.53ME Amort. 4.972% (Belgique)	DEXIA	39429	13-déc.-07	31-déc.-16	END	3m	EUR	VRAI	4.9720%	531,250.00	265,628.00
FORT11-F	Emprunt 3.61ME Amort. 4.20%	FORTIS	30-nov-04	31-déc.-06	31-déc.-21	END	1m	EUR	VRAI	4.2000%	3,610,000.00	2,243,909.25
BRES1-F	Emprunt 12M Amort. 5.67%	BRESCIA	39447	31-déc.-07	31-déc.-22	END	3m	EUR	VRAI	5.6700%	12,000,000.00	8,811,587.17
CONV1-F	Obligation convertible 180ME 3.875% OCEANE	OBLIG	15-déc-10	1-janv.-12	1-janv.-16	END	1y	EUR	FAUX	3.8750%	179,999,956.05	179,999,956.05
FINA8-F	Crédit-bail 21.5ME OSEO + Finamur	FINAMUR	23-déc-09	1-oct.-10	1-janv.-23	END	3m	EUR	FAUX	5.3500%	10,750,000.00	10,750,000.00
BNP12-F	Emprunt Le Jardin des Lys 2.2ME TF 4.05%	BNP	39447	31-déc.-07	31-déc.-17	END	1m	EUR	VRAI	4.0500%	2,234,000.00	1,079,587.39
OSEO16-F	CBI Brantôme 3.53ME Taux Fixe 4.27%	OSEO	39534	27-mars-08	27-déc.-19	END	3m	EUR	VRAI	4.2700%	3,535,358.00	2,309,632.77
OSEO17-F	CBI Brantôme 0.81ME Taux Fixe 4.27%	OSEO	39534	27-déc.-07	27-déc.-19	END	3m	EUR	VRAI	4.2700%	814,642.00	522,199.54
CADEP4-F	Empunt 2.4ME Taux fixe 4.15%	CAISSE D'EP	09-juin-10	30-juin-10	30-juin-19	END	3m	EUR	VRAI	4.1500%	2,400,000.00	1,940,538.54
DB1-F	Emprunt 20ME Taux fixe 5.00% (Schuldschein)	OBLIG	27-mars-12	30-mars-12	30-mars-17	END	3m	EUR	FAUX	5.0000%	20,000,000.00	20,000,000.00
BRES2-F	Crédit-bail 8.25ME Taux Fixe 3.64%	BRESCIA	01-oct-07	1-oct.-07	31-déc.-21	END	1y	EUR	FAUX	3.6384%	8,248,000.00	8,248,000.00
BRES3-F	Crédit-bail 9.99ME Taux Fixe 4.46%	BRESCIA	10-nov-06	14-nov.-06	14-nov.-21	END	1m	EUR	VRAI	4.4600%	9,996,000.00	6,947,977.99
BRES4-F	Crédit-bail 5ME Taux Fixe 4.39%	BRESCIA	06-juin-07	6-juin-07	31-déc.-21	END	1y	EUR	FAUX	4.3942%	5,005,000.00	5,005,000.00
KBC6-F	Emprunt 6.76ME Taux Fixe 5.92%	KBC	07-juil-07	30-juin-10	30-juin-28	END	3m	EUR	VRAI	5.9200%	6,758,000.00	6,117,572.96
KBC7-F	Emprunt 5.98ME Taux Fixe 5.92%	KBC	17-juil-07	1-janv.-09	31-mars-28	END	3m	EUR	VRAI	5.9200%	5,980,000.00	5,415,111.19
CADEP5-F	Emprunt 4.33ME Taux Fixe 3.30%	CAISSE D'EP	12-janv-11	12-janv.-11	1-févr.-26	END	1m	EUR	VRAI	3.3000%	4,330,000.00	3,728,214.81
CAGR10-F	Emprunt 23.1MFF Taux Fixe 6.20%	CA	12-janv-01	12-janv.-01	15-janv.-16	END	1m	EUR	VRAI	6.2000%	3,521,572.30	808,686.76
CADEP6-F	Emprunt 1.77ME Taux Fixe 4.40%	CAISSE D'EP	23-mai-07	5-juil.-06	5-juin-17	END	1m	EUR	VRAI	4.4000%	1,770,000.00	771,594.48
CAIB8-F	Emprunt obligataire Tranche A 65ME Taux Fixe 4.10%	CACIB	21-nov-12	30-nov.-12	10-janv.-18	END	1y	EUR	FAUX	4.1000%	65,000,000.00	65,000,000.00
CAIB8-F	Emprunt obligataire Tranche B 128ME Taux Fixe 4.60%	CACIB	41234	30-nov.-12	30-mai-19	END	1y	EUR	FAUX	4.6000%	128,000,000.00	128,000,000.00
DB4-F	Note 90ME Taux Fixe 5.25%	DB	04-déc-12	4-déc.-12	4-déc.-26	END	1y	EUR	FAUX	5.2500%	90,000,000.00	90,000,000.00
KEP1-F	Note 20ME Taux Fixe 4.20%	KEPLER	30-nov-12	30-nov.-12	30-nov.-18	END	1y	EUR	FAUX	4.2000%	20,000,000.00	20,000,000.00
DB4-F	Loan 10ME Taux fixe 5.25%	DB	41247	4-déc.-12	4-déc.-26	END	1y	EUR	FAUX	5.2500%	10,000,000.00	10,000,000.00
CEL1-F	Emprunt 20ME Taux Fixe 2,45%	CAISSE D'EP	15-mars-13	15-mars-13	15-mars-18	END	3m	EUR	VRAI	2.4500%	20,000,000.00	19,056,944.22
CAIB8-F	Emprunt Obligataire Tranche TAP 33ME Taux Fixe 4,60%	CACIB	41243	30-nov.-12	30-mai-19	END	1y	EUR	FAUX	4.6000%	33,000,000.00	33,000,000.00
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 1.08ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	1,082,542.03	1,171,636.22
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 7.30ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	7,295,994.68	7,896,461.91
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 3.92ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	3,917,120.75	4,239,503.83
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 7.30ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	7,295,994.68	7,896,461.91
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 1.70ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	1,704,342.55	1,844,611.53
ORNA1-F	Emprunt obligataire Ormane 198ME Taux Fixe 1,75%	NATIXIS	09-juil-13	17-juil.-13	1-janv.-20	END	1y	EUR	FAUX	1.7500%	198,374,979.36	198,374,979.36
DEGR1-F	Emprunt obligataire belge 55ME Taux Fixe 4%	DEGROOF	03-juil-13	3-juil.-13	31-déc.-18	END	1y	EUR	FAUX	4.0000%	55,000,000.00	55,000,000.00
DEGR2-F	Emprunt obligataire belge 20ME Taux Fixe 4,45%	DEGROOF	03-juil-13	3-juil.-13	31-déc.-20	END	1y	EUR	FAUX	4.4500%	20,000,000.00	20,000,000.00
KEP2-F	Emprunt obligataire 20ME Taux Fixe 4,15%	KEPLER	15-juil-13	15-juil.-13	30-nov.-19	END	1y	EUR	FAUX	4.1500%	20,000,000.00	20,000,000.00
											963,961,002.40	947,830,582.87

Strategy ID	Trade Description	Counterparty	Trade date	Effective Date	Maturity Date	Payment Timing	Tenor	Not CCY	Amortizing	Rate	Initial Amount	Current Amount
DEXI2-F	Emprunt 1.80ME Amort. 5.214% (Belgique)	DEXIA	39429	13-déc.-07	31-déc.-24	END	3m	EUR	VRAI	5.2140%	1,806,250.00	1,384,787.00
DEXI3-F	Emprunt 0.53ME Amort. 4.972% (Belgique)	DEXIA	39429	13-déc.-07	31-déc.-16	END	3m	EUR	VRAI	4.9720%	531,250.00	265,628.00
FORT11-F	Emprunt 3.61ME Amort. 4.20%	FORTIS	30-nov-04	31-déc.-06	31-déc.-21	END	1m	EUR	VRAI	4.2000%	3,610,000.00	2,243,909.25
BRES1-F	Emprunt 12M Amort. 5.67%	BRESCIA	39447	31-déc.-07	31-déc.-22	END	3m	EUR	VRAI	5.6700%	12,000,000.00	8,811,587.17
CONV1-F	Obligation convertible 180ME 3.875% OCEANE	OBLIG	15-déc-10	1-janv.-12	1-janv.-16	END	1y	EUR	FAUX	3.8750%	179,999,956.05	179,999,956.05
FINA8-F	Crédit-bail 21.5ME OSEO + Finamur	FINAMUR	23-déc-09	1-oct.-10	1-janv.-23	END	3m	EUR	FAUX	5.3500%	10,750,000.00	10,750,000.00
BNP12-F	Emprunt Le Jardin des Lys 2.2ME TF 4.05%	BNP	39447	31-déc.-07	31-déc.-17	END	1m	EUR	VRAI	4.0500%	2,234,000.00	1,079,587.39
OSEO16-F	CBI Brantôme 3.53ME Taux Fixe 4.27%	OSEO	39534	27-mars-08	27-déc.-19	END	3m	EUR	VRAI	4.2700%	3,535,358.00	2,309,632.77
OSEO17-F	CBI Brantôme 0.81ME Taux Fixe 4.27%	OSEO	39534	27-déc.-07	27-déc.-19	END	3m	EUR	VRAI	4.2700%	814,642.00	522,199.54
CADEP4-F	Empunt 2.4ME Taux fixe 4.15%	CAISSE D'EP	09-juin-10	30-juin-10	30-juin-19	END	3m	EUR	VRAI	4.1500%	2,400,000.00	1,940,538.54
DB1-F	Emprunt 20ME Taux fixe 5.00% (Schuldschein)	OBLIG	27-mars-12	30-mars-12	30-mars-17	END	3m	EUR	FAUX	5.0000%	20,000,000.00	20,000,000.00
BRES2-F	Crédit-bail 8.25ME Taux Fixe 3.64%	BRESCIA	01-oct-07	1-oct.-07	31-déc.-21	END	1y	EUR	FAUX	3.6384%	8,248,000.00	8,248,000.00
BRES3-F	Crédit-bail 9.99ME Taux Fixe 4.46%	BRESCIA	10-nov-06	14-nov.-06	14-nov.-21	END	1m	EUR	VRAI	4.4600%	9,996,000.00	6,947,977.99
BRES4-F	Crédit-bail 5ME Taux Fixe 4.39%	BRESCIA	06-juin-07	6-juin-07	31-déc.-21	END	1y	EUR	FAUX	4.3942%	5,005,000.00	5,005,000.00
KBC6-F	Emprunt 6.76ME Taux Fixe 5.92%	KBC	07-juil-07	30-juin-10	30-juin-28	END	3m	EUR	VRAI	5.9200%	6,758,000.00	6,117,572.96
KBC7-F	Emprunt 5.98ME Taux Fixe 5.92%	KBC	17-juil-07	1-janv.-09	31-mars-28	END	3m	EUR	VRAI	5.9200%	5,980,000.00	5,415,111.19
CADEP5-F	Emprunt 4.33ME Taux Fixe 3.30%	CAISSE D'EP	12-janv-11	12-janv.-11	1-févr.-26	END	1m	EUR	VRAI	3.3000%	4,330,000.00	3,728,214.81
CAGR10-F	Emprunt 23.1MFF Taux Fixe 6.20%	CA	12-janv-01	12-janv.-01	15-janv.-16	END	1m	EUR	VRAI	6.2000%	3,521,572.30	808,686.76
CADEP6-F	Emprunt 1.77ME Taux Fixe 4.40%	CAISSE D'EP	23-mai-07	5-juil.-06	5-juin-17	END	1m	EUR	VRAI	4.4000%	1,770,000.00	771,594.48
CAIB8-F	Emprunt obligataire Tranche A 65ME Taux Fixe 4.10%	CACIB	21-nov-12	30-nov.-12	10-janv.-18	END	1y	EUR	FAUX	4.1000%	65,000,000.00	65,000,000.00
CAIB8-F	Emprunt obligataire Tranche B 128ME Taux Fixe 4.60%	CACIB	41234	30-nov.-12	30-mai-19	END	1y	EUR	FAUX	4.6000%	128,000,000.00	128,000,000.00
DB4-F	Note 90ME Taux Fixe 5.25%	DB	04-déc-12	4-déc.-12	4-déc.-26	END	1y	EUR	FAUX	5.2500%	90,000,000.00	90,000,000.00
KEP1-F	Note 20ME Taux Fixe 4.20%	KEPLER	30-nov-12	30-nov.-12	30-nov.-18	END	1y	EUR	FAUX	4.2000%	20,000,000.00	20,000,000.00
DB4-F	Loan 10ME Taux fixe 5.25%	DB	41247	4-déc.-12	4-déc.-26	END	1y	EUR	FAUX	5.2500%	10,000,000.00	10,000,000.00
CEL1-F	Emprunt 20ME Taux Fixe 2,45%	CAISSE D'EP	15-mars-13	15-mars-13	15-mars-18	END	3m	EUR	VRAI	2.4500%	20,000,000.00	19,056,944.22
CAIB8-F	Emprunt Obligataire Tranche TAP 33ME Taux Fixe 4,60%	CACIB	41243	30-nov.-12	30-mai-19	END	1y	EUR	FAUX	4.6000%	33,000,000.00	33,000,000.00
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 1.08ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	1,082,542.03	1,171,636.22
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 7.30ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	7,295,994.68	7,896,461.91
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 3.92ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	3,917,120.75	4,239,503.83
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 7.30ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	7,295,994.68	7,896,461.91
FRUCTI1-F	Crédit-bail Livry Gargan 1.70ME Taux Fixe 4%	FRUCTICOMI	01-janv-11	1-janv.-11	1-janv.-31	END	3m	EUR	VRAI	4.0000%	1,704,342.55	1,844,611.53
ORNA1-F	Emprunt obligataire Ormane 198ME Taux Fixe 1,75%	NATIXIS	09-juil-13	17-juil.-13	1-janv.-20	END	1y	EUR	FAUX	1.7500%	198,374,979.36	198,374,979.36
DEGR1-F	Emprunt obligataire belge 55ME Taux Fixe 4%	DEGROOF	03-juil-13	3-juil.-13	31-déc.-18	END	1y	EUR	FAUX	4.0000%	55,000,000.00	55,000,000.00
DEGR2-F	Emprunt obligataire belge 20ME Taux Fixe 4,45%	DEGROOF	03-juil-13	3-juil.-13	31-déc.-20	END	1y	EUR	FAUX	4.4500%	20,000,000.00	20,000,000.00
KEP2-F	Emprunt obligataire 20ME Taux Fixe 4,15%	KEPLER	15-juil-13	15-juil.-13	30-nov.-19	END	1y	EUR	FAUX	4.1500%	20,000,000.00	20,000,000.00
											963,961,002.40	947,830,582.87

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.