

# FCPE HSBC EE DYNAMIQUE

## Rapport semestriel au 28 juin 2024

*(Document périodique non certifié par le Commissaire aux Comptes)*

# FCPE HSBC EE DYNAMIQUE

## Etat du patrimoine en EUR

| Eléments de l'état du patrimoine  | Montant à l'arrêté périodique (*) |
|---|-----------------------------------|
| a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-24-55 du code monétaire et financier |                                   |
| b) Avoirs bancaires   | 60 580,77                         |
| c) Autres actifs détenus par l'OPC  | 72 649 893,04                     |
| d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)  | 72 710 473,81                     |
| e) Passif   | -66 663,32                        |
| f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)  | 72 643 810,49                     |

(\*) Les montants sont signés

## Nombre de parts en circulation et valeur nette d'inventaire par part

| Part                        | Type de part | Actif net de la part | Nombre de parts en circulation | Valeur nette d'inventaire par part |
|-----------------------------|--------------|----------------------|--------------------------------|------------------------------------|
| HSBC EE DYNAMIQUE E en EUR  | C            | 23 058 686,00        | 826 558,07420                  | 27,897                             |
| HSBC EE DYNAMIQUE F en EUR  | C            | 32 149 081,14        | 1 232 388,07470                | 26,086                             |
| HSBC EE DYNAMIQUE G en EUR  | C            | 15 727 879,21        | 1 384 670,20650                | 11,358                             |
| HSBC EE DYNAMIQUE PG en EUR | C            | 1 708 164,14         | 154 150,34110                  | 11,081                             |

# FCPE HSBC EE DYNAMIQUE

## Elément du portefeuille titres

| Eléments du portefeuille titres  | Pourcentage actif net (*) | Pourcentage total des actifs (**) |
|--|---------------------------|-----------------------------------|
| A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier.  |                           |                                   |
| Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.   |                           |                                   |
| C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts du fonds d'investissement à vocation générale. |                           |                                   |
| D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4 ° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.   |                           |                                   |
| E) Les autres actifs.  | 100,00                    | 99,91                             |

(\*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(\*\*) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

# FCPE HSBC EE DYNAMIQUE

## Répartition des actifs du A), B), C) et D) du portefeuille titres, par devise

| Titres | Devise | En montant (EUR) | Pourcentage actif net (*) | Pourcentage total des actifs (**) |
|--------|--------|------------------|---------------------------|-----------------------------------|
| NEANT  |        |                  |                           |                                   |

(\*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(\*\*) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

# FCPE HSBC EE DYNAMIQUE

## Répartition des actifs du A), B), C) et D) du portefeuille titres, par pays de résidence de l'émetteur

| Pays  | Pourcentage actif net (*) | Pourcentage total des actifs (**) |
|-------|---------------------------|-----------------------------------|
| NEANT |                           |                                   |

(\*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(\*\*) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

# FCPE HSBC EE DYNAMIQUE

## Répartition des autres actifs du E) du portefeuille titres, par nature

| Nature d'actifs   | Pourcentage actif net (*) | Pourcentage total des actifs (**) |
|---|---------------------------|-----------------------------------|
| OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne | 100,00                    | 99,91                             |
| Autres OPC et fonds d'investissements                             |                           |                                   |
| FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne   |                           |                                   |
| Autres  |                           |                                   |
| <b>TOTAL</b>  | <b>100,00</b>             | <b>99,91</b>                      |

(\*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(\*\*) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

# FCPE HSBC EE DYNAMIQUE

## Mouvements dans le portefeuille titres en cours de période en EUR

| Eléments du portefeuille titres  | Mouvements (en montant) |              |
|--|-------------------------|--------------|
|  | Acquisitions            | Cessions     |
| A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier.  |                         |              |
| Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.   |                         |              |
| C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts du fonds d'investissement à vocation générale. |                         |              |
| D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4 ° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.   |                         |              |
| E) Les autres actifs.  | 6 833 812,16            | 9 416 691,49 |

# FCPE HSBC EE DYNAMIQUE

## Informations pratiques

Le dernier rapport annuel et le dernier rapport semestriel de l'OPC maître sont disponibles en français sur simple demande gratuitement auprès du service clients de la société de gestion par mail : [hsbc.client.services-am@hsbc.fr](mailto:hsbc.client.services-am@hsbc.fr).

Le rapport semestriel de l'OPC maître est annexé au présent rapport semestriel.

# FCPE HSBC EE DYNAMIQUE

## **Information sur les actifs non liquides et les dispositions pour gérer la liquidité de l'OPC**

### Gestion du risque de liquidité :

La société de gestion assure le suivi du risque de liquidité par OPC afin d'assurer un niveau approprié de liquidité à chaque OPC au regard notamment du profil de risque, des stratégies d'investissement et politiques de remboursement en vigueur des OPC.

Une analyse du risque de liquidité des OPC visant à s'assurer que les investissements et les OPC présentent une liquidité suffisante pour honorer le rachat des porteurs de parts dans des conditions normales et extrêmes de marché est effectuée au moins une fois par mois par la société de gestion.

Une dégradation observée de la liquidité des marchés et des mouvements de passif significatifs auraient pour conséquence, en fonction du profil de risque de chaque OPC, le renforcement du dispositif matérialisé par l'augmentation significative de la fréquence de contrôle de la liquidité des OPC.

La société de gestion a mis en place un dispositif et des outils de gestion de la liquidité permettant le traitement équitable des investisseurs.

Actifs qui font l'objet d'un traitement spécial du fait de leur nature non liquide : néant.

## **Information sur le profil de risque actuel de l'OPC et les systèmes de gestion du risque utilisés par la société de gestion**

Le profil de risque actuel de l'OPC est indiqué dans le DIC figurant dans la première partie du rapport annuel.

La société de gestion met en œuvre et maintient opérationnelle une politique et des procédures de gestion des risques efficaces, appropriées et documentés qui permettent d'identifier les risques liés à son activité en particulier la société de gestion a mis en œuvre les dispositions et les mesures permettant d'évaluer le risque global des OPC et d'identifier notamment les risques principaux auxquels les OPC sont exposés ou susceptibles d'être exposés.

## **Information sur le montant total du levier calculé selon la méthode brute et la méthode de l'engagement utilisées par l'OPC**

- Montant total du levier calculé selon la méthode brute : 100%.
- Montant total du levier calculé selon la méthode de l'engagement : 100%.

Ces méthodes sont décrites dans le règlement délégué (UE) n°231/2013 de la Commission du 19 décembre 2012.

# FCPE HSBC EE DYNAMIQUE

## Inventaire des actifs et passifs

### Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*) | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle      | % Actif Net   |
|--|--------|---------------------|----------------------|---------------|
| <b>TITRES D'OPC</b>                                |        |                     | <b>72 642 646,27</b> | <b>100,00</b> |
| <b>OPCVM</b>                                       |        |                     | <b>72 642 646,27</b> | <b>100,00</b> |
| <b>Gestion collective</b>                          |        |                     | <b>72 642 646,27</b> | <b>100,00</b> |
| HSBC MIX DYNAMIQUE I                               | EUR    | 52 423,447          | 72 642 646,27        | 100,00        |
| <b>Total</b>                                       |        |                     | <b>72 642 646,27</b> | <b>100,00</b> |

(\*) Le secteur d'activité représente l'activité principale de l'émetteur de l'instrument financier ; il est issu de sources fiables reconnues au plan international (GICS et NACE principalement).

### Inventaire des opérations à terme de devises

| Type d'opération | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |             |                      |             |
|------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|-------------|----------------------|-------------|
|                  | Actif                              | Passif | Devises à recevoir (+)      |             | Devises à livrer (-) |             |
|                  |                                    |        | Devise                      | Montant (*) | Devise               | Montant (*) |
| <b>Total</b>     |                                    |        |                             |             |                      |             |

(\*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions exprimé dans la devise de comptabilisation.

# FCPE HSBC EE DYNAMIQUE

## Inventaire des instruments financiers à terme

### Inventaire des instruments financiers à terme - actions

| Nature d'engagements         | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|------------------------------|---------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
|                              |                     | Actif                              | Passif | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>Total</b>                 |                     |                                    |        |                             |

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

### Inventaire des instruments financiers à terme - taux d'intérêts

| Nature d'engagements         | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|------------------------------|---------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
|                              |                     | Actif                              | Passif | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>Total</b>                 |                     |                                    |        |                             |

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

# FCPE HSBC EE DYNAMIQUE

## Inventaire des instruments financiers à terme - de change

| Nature d'engagements         | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|------------------------------|---------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
|                              |                     | Actif                              | Passif | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>Total</b>                 |                     |                                    |        |                             |

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

## Inventaire des instruments financiers à terme - sur risque de crédit

| Nature d'engagements         | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|------------------------------|---------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
|                              |                     | Actif                              | Passif | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>Total</b>                 |                     |                                    |        |                             |

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

# FCPE HSBC EE DYNAMIQUE

## Inventaire des instruments financiers à terme - autres expositions

| Nature d'engagements         | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|------------------------------|---------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
|                              |                     | Actif                              | Passif | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>Total</b>                 |                     |                                    |        |                             |

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

## Inventaire des instruments financiers à terme ou des opérations à terme de devises utilisés en couverture d'une catégorie de part

L'OPC sous revue n'est pas concerné par cette rubrique.

# FCPE HSBC EE DYNAMIQUE

## Synthèse de l'inventaire

|  | Valeur actuelle présentée au bilan |
|--|------------------------------------|
| Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)                          | 72 642 646,27                      |
| Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :               |                                    |
| Total opérations à terme de devises  |                                    |
| Total instruments financiers à terme - actions                                       |                                    |
| Total instruments financiers à terme - taux  |                                    |
| Total instruments financiers à terme - change  |                                    |
| Total instruments financiers à terme - crédit  |                                    |
| Total instruments financiers à terme - autres expositions                            |                                    |
| Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises |                                    |
| Autres actifs (+)  | 67 827,54                          |
| Autres passifs (-)   | -66 663,32                         |
| Passifs de financement (-)   |                                    |
| <b>Total = actif net</b>   | <b>72 643 810,49</b>               |

| Libellé de la part        | Devise de la part | Nombre de parts | Valeur liquidative |
|---------------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| Part HSBC EE DYNAMIQUE E  | EUR               | 826 558,07420   | 27,897             |
| Part HSBC EE DYNAMIQUE F  | EUR               | 1 232 388,07470 | 26,086             |
| Part HSBC EE DYNAMIQUE G  | EUR               | 1 384 670,20650 | 11,358             |
| Part HSBC EE DYNAMIQUE PG | EUR               | 154 150,34110   | 11,081             |

# FCPE HSBC EE DYNAMIQUE

Rapport semestriel de l'OPC Maître

# FCP de droit français HSBC MIX DYNAMIQUE

## Rapport semestriel au 28 juin 2024

*(Document périodique non certifié par le Commissaire aux Comptes)*

# FCP HSBC MIX DYNAMIQUE

## Etat du patrimoine en EUR

| Eléments de l'état du patrimoine   | Montant à l'arrêté périodique (*) |
|--|-----------------------------------|
| a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier | 27 733 630,75                     |
| b) Avoirs bancaires  | 7 458 414,67                      |
| c) Autres actifs détenus par l'OPC   | 186 592 959,00                    |
| d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)   | 221 785 004,42                    |
| e) Passif  | -2 476 410,08                     |
| f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)   | 219 308 594,34                    |

(\*) Les montants sont signés

## Nombre de parts en circulation et valeur nette d'inventaire par part

| Part                        | Type de part | Actif net de la part | Nombre de parts en circulation | Valeur nette d'inventaire par part |
|-----------------------------|--------------|----------------------|--------------------------------|------------------------------------|
| HSBC MIX DYNAMIQUE A en EUR | C            | 146 665 683,06       | 329 681,216                    | 444,87                             |
| HSBC MIX DYNAMIQUE I en EUR | C            | 72 642 911,28        | 52 423,447                     | 1 385,69                           |

# FCP HSBC MIX DYNAMIQUE

## Elément du portefeuille titres

| Eléments du portefeuille titres  | Pourcentage actif net (*) | Pourcentage total des actifs (**) |
|--|---------------------------|-----------------------------------|
| A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier.<br><br>Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.                      | 9,83                      | 9,72                              |
| C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières. | 2,82                      | 2,79                              |
| D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.  |                           |                                   |
| E) Les autres actifs.  | 80,90                     | 80,00                             |

(\*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(\*\*) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

# FCP HSBC MIX DYNAMIQUE

## Répartition des actifs du A), B), C) et D) du portefeuille titres, par devise

| Titres            | Devise | En montant (EUR)     | Pourcentage actif net (*) | Pourcentage total des actifs (**) |
|-------------------|--------|----------------------|---------------------------|-----------------------------------|
| Couronne Suédoise | SEK    | 2 487 198,55         | 1,13                      | 1,12                              |
| Euro              | EUR    | 23 250 505,18        | 10,60                     | 10,48                             |
| Yen Japonais      | JPY    | 1 995 927,02         | 0,91                      | 0,90                              |
| <b>TOTAL</b>      |        | <b>27 733 630,75</b> | <b>12,65</b>              | <b>12,50</b>                      |

(\*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(\*\*) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

# FCP HSBC MIX DYNAMIQUE

## Répartition des actifs du A), B), C) et D) du portefeuille titres, par pays de résidence de l'émetteur

| Pays         | Pourcentage actif net (*) | Pourcentage total des actifs (**) |
|--------------|---------------------------|-----------------------------------|
| ESPAGNE      | 3,07                      | 3,04                              |
| FRANCE       | 2,28                      | 2,26                              |
| CANADA       | 1,91                      | 1,89                              |
| NORVEGE      | 1,65                      | 1,63                              |
| SUEDE        | 1,13                      | 1,12                              |
| JAPON        | 0,91                      | 0,90                              |
| BELGIQUE     | 0,70                      | 0,70                              |
| PAYS-BAS     | 0,40                      | 0,39                              |
| LUXEMBOURG   | 0,34                      | 0,33                              |
| PORTUGAL     | 0,25                      | 0,25                              |
| <b>TOTAL</b> | <b>12,65</b>              | <b>12,50</b>                      |

(\*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(\*\*) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

# FCP HSBC MIX DYNAMIQUE

## Répartition des autres actifs du E) du portefeuille titres, par nature

| Nature d'actifs   | Pourcentage actif net (*) | Pourcentage total des actifs (**) |
|---|---------------------------|-----------------------------------|
| OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne | 80,90                     | 80,00                             |
| Autres OPC et fonds d'investissements                             |                           |                                   |
| FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne   |                           |                                   |
| Autres  |                           |                                   |
| <b>TOTAL</b>  | <b>80,90</b>              | <b>80,00</b>                      |

(\*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(\*\*) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

# FCP HSBC MIX DYNAMIQUE

## Mouvements dans le portefeuille titres en cours de période en EUR

| Eléments du portefeuille titres  | Mouvements (en montant) |               |
|--|-------------------------|---------------|
|  | Acquisitions            | Cessions      |
| A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier.<br>Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.                          | 9 723 441,41            | 12 312 719,57 |
| C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières. | 4 166 628,56            | 11 091,85     |
| D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.  |                         |               |
| E) Les autres actifs.  | 41 939 075,29           | 51 141 737,13 |

# FCP HSBC MIX DYNAMIQUE

**Transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation des instruments financiers - Règlement SFTR - en devise de comptabilité de l'OPC (EUR)**

Au cours de l'exercice, l'OPC n'a pas fait l'objet d'opération relevant de la réglementation SFTR.

# FCP HSBC MIX DYNAMIQUE

## Inventaire des actifs et passifs

### Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)                                      | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle       | % Actif Net  |
|---|--------|---------------------|-----------------------|--------------|
| <b>OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES</b>  |        |                     | <b>27 733 630,75</b>  | <b>12,65</b> |
| <b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b> |        |                     | <b>27 733 630,75</b>  | <b>12,65</b> |
| <b>Banques commerciales</b>   |        |                     | <b>2 836 535,51</b>   | <b>1,29</b>  |
| AFD 3.0% 17-01-34   | EUR    | 2 100 000           | 2 049 932,90          | 0,93         |
| TORONTO DOMINION BANK 3.247% 16-02-34   | EUR    | 780 000             | 786 602,61            | 0,36         |
| <b>Marchés de capitaux</b>  |        |                     | <b>3 395 271,37</b>   | <b>1,55</b>  |
| FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS QUEBEC 2.0% 31-08-26                                  | EUR    | 1 950 000           | 1 926 865,81          | 0,88         |
| FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS QUEBEC 3.125% 30-05-29                                | EUR    | 1 469 000           | 1 468 405,56          | 0,67         |
| <b>Services aux collectivités</b>   |        |                     | <b>14 174 266,40</b>  | <b>6,46</b>  |
| BANQUE EUROPEAN D'INVESTISSEMENT 0.01% 15-11-35   | EUR    | 517 000             | 365 523,05            | 0,17         |
| BANQUE EUROPEAN D'INVESTISSEMENT 0.2% 17-03-36  | EUR    | 517 000             | 370 343,28            | 0,17         |
| COMMUNAUTE EUROPEAN BRU 0.3% 04-11-50   | EUR    | 746 000             | 360 855,43            | 0,16         |
| EUROPEAN UNION 3.0% 04-03-53  | EUR    | 1 293 000           | 1 185 212,95          | 0,54         |
| JAPAN 30 YEAR ISSUE 1.0% 20-03-52   | JPY    | 447 750 000         | 1 995 927,02          | 0,91         |
| KINGDOM OF SWEDEN 0.125% 12-05-31   | SEK    | 32 335 000          | 2 487 198,55          | 1,14         |
| PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 2.25% 18-04-34  | EUR    | 597 000             | 554 361,24            | 0,25         |
| SOCIETE DU GRAND PARIS 0.875% 10-05-46  | EUR    | 200 000             | 113 724,11            | 0,05         |
| SPAIN GOVERNMENT BOND 0.7% 30-04-32   | EUR    | 1 492 000           | 1 240 162,66          | 0,57         |
| SPAIN GOVERNMENT BOND 0.85% 30-07-37  | EUR    | 2 487 000           | 1 801 059,85          | 0,82         |
| SPAIN GOVERNMENT BOND 1.9% 31-10-52   | EUR    | 2 075 000           | 1 389 282,18          | 0,63         |
| SPAIN GOVERNMENT BOND 2.55% 31-10-32  | EUR    | 2 388 000           | 2 310 616,08          | 1,05         |
| <b>Services aux entreprises</b>   |        |                     | <b>920 749,50</b>     | <b>0,42</b>  |
| LA POSTE 0.0000010% 18-07-29  | EUR    | 1 100 000           | 920 749,50            | 0,42         |
| <b>Services financiers diversifiés</b>  |        |                     | <b>4 485 295,16</b>   | <b>2,05</b>  |
| BNG BANK NV 1.5% 15-07-39 EMTN  | EUR    | 1 100 000           | 874 705,93            | 0,40         |
| DNB BOLIGKREDITT 2.875% 12-03-29  | EUR    | 1 450 000           | 1 447 537,78          | 0,66         |
| SPAREBANK 1 BOLIGKREDITT 3.0% 15-05-34  | EUR    | 2 200 000           | 2 163 051,45          | 0,99         |
| <b>Transport routier et ferroviaire</b>   |        |                     | <b>1 921 512,81</b>   | <b>0,88</b>  |
| SNCF RESEAU 0.75% 25-05-36  | EUR    | 1 400 000           | 1 010 458,15          | 0,46         |
| SOCIETE NATLE SNCF 3.125% 02-11-27  | EUR    | 900 000             | 911 054,66            | 0,42         |
| <b>TITRES D'OPC</b>   |        |                     | <b>177 418 693,23</b> | <b>80,90</b> |
| <b>OPCVM</b>  |        |                     | <b>177 418 693,23</b> | <b>80,90</b> |
| <b>Gestion collective</b>   |        |                     | <b>177 418 693,23</b> | <b>80,90</b> |
| ASIA EX JAPAN EQUITY SMALLER COMPANIES Z  | USD    | 85 397,138          | 1 573 363,09          | 0,72         |
| EUROLAND GROWTH ZC  | EUR    | 461 877,341         | 9 745 611,90          | 4,44         |

# FCP HSBC MIX DYNAMIQUE

## Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)          | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle       | % Actif Net  |
|---|--------|---------------------|-----------------------|--------------|
| HSBC EURO ACTIONS ZC  | EUR    | 9 957,118           | 17 936 055,37         | 8,18         |
| HSBC EURO EQUITY VOLATILITY FOCUSED Z                       | EUR    | 10 173,779          | 15 344 195,23         | 7,00         |
| HSBC EUROLAND EQ.SMALLER Z C.                               | EUR    | 79 957,282          | 8 290 610,66          | 3,78         |
| HSBC EUROLAND EQUITY Z CAP.                                 | EUR    | 53 848,081          | 4 429 704,69          | 2,02         |
| HSBC Europe Equity Quality Income Z                         | EUR    | 227,957             | 4 857 731,76          | 2,22         |
| HSBC EURO PME PART Z  | EUR    | 2 025,618           | 2 566 316,21          | 1,17         |
| HSBC FTSE 100 ETF   | GBP    | 31 175              | 3 023 737,84          | 1,38         |
| HSBC GBF ICAV MLTFAC E E ZC                                 | EUR    | 3 311 543,34<br>2   | 41 663 520,25         | 18,99        |
| HSBC GFI-MULTI FACT US EQ-ZC                                | USD    | 483 759,545         | 5 277 413,78          | 2,41         |
| HSBC GI CHIN EQ ZC  | USD    | 8 341,149           | 796 267,45            | 0,36         |
| HSBC GIF-BRAZIL EQUITY-ZA                                   | USD    | 85 742,312          | 1 674 765,16          | 0,76         |
| HSBC GIF MULTI ASSET STYLE FACTORS ZC                       | EUR    | 292 711,752         | 3 568 741,68          | 1,63         |
| HSBC GL EURO CREDIT BD TR ZC                                | EUR    | 688 201,536         | 8 835 131,32          | 4,03         |
| HSBC GL INV-IND FIX IN-ZD                                   | USD    | 160 389,928         | 1 281 772,55          | 0,58         |
| HSBC GLOBAL FUNDS ICAV CROSS ASSET TREND FUND S1CH EUR ACC  | EUR    | 327 226,365         | 3 292 518,96          | 1,50         |
| HSBC GLOBAL INV. FD TURKEY Class I                          | EUR    | 9 075               | 702 032,93            | 0,32         |
| HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS ASIA HIGH YIELD BOND ZC        | USD    | 488 844,561         | 3 431 376,38          | 1,56         |
| HSBC Global Investment Funds - European Equity ZC           | EUR    | 259 166,078         | 3 444 835,51          | 1,57         |
| HSBC MSCI CANADA ETF  | EUR    | 97 410              | 2 051 649,42          | 0,94         |
| HSBC MSCI JAPAN   | EUR    | 107 992             | 4 036 201,00          | 1,84         |
| HSBC MSCI PACIFIC EX JAPAN UCITS ETF USD                    | EUR    | 134 915             | 1 692 103,93          | 0,77         |
| HSBC RIF SRI EUROLAND EQUITY Z                              | EUR    | 46 893,917          | 6 432 438,59          | 2,93         |
| HSBC S AND P 500 ETF  | USD    | 84 768              | 4 405 681,85          | 2,01         |
| HSBC SRI MONEY ZC   | EUR    | 1 640,995           | 2 360 628,74          | 1,08         |
| ISHARES BLOOMBERG ROLL SELECT COMMODITY SWAP UCITS ETF      | USD    | 682 796             | 4 782 598,15          | 2,18         |
| PASSIM STR CRS AST TRD STR B                                | EUR    | 28 871,3875         | 3 312 125,57          | 1,51         |
| SPDR SP 500 Low Volatility UCITS ETF                        | EUR    | 58 529              | 3 940 172,28          | 1,80         |
| STRUCTURED INVESTMENTS SICAV GS CROSS ASSET TREND PORTFOLIO | EUR    | 233 222,169         | 2 669 390,98          | 1,22         |
| <b>Total</b>  |        |                     | <b>205 152 323,98</b> | <b>93,55</b> |

(\*) Le secteur d'activité représente l'activité principale de l'émetteur de l'instrument financier ; il est issu de sources fiables reconnues au plan international (GICS et NACE principalement).

# FCP HSBC MIX DYNAMIQUE

## Inventaire des opérations à terme de devises

| Type d'opération   | Valeur actuelle présentée au bilan |                    | Montant de l'exposition (*) |                       |                      |                        |
|--------------------|------------------------------------|--------------------|-----------------------------|-----------------------|----------------------|------------------------|
|                    | Actif                              | Passif             | Devises à recevoir (+)      |                       | Devises à livrer (-) |                        |
|                    |                                    |                    | Devise                      | Montant (*)           | Devise               | Montant (*)            |
| V/AUD/EUR/20240906 |                                    | -25 756,48         | EUR                         | 6 093 667,76          | AUD                  | -6 119 424,24          |
| V/CAD/EUR/20240906 | 5 917,03                           |                    | EUR                         | 5 319 727,12          | CAD                  | -5 313 810,09          |
| V/CAD/EUR/20240906 | 5 338,26                           |                    | EUR                         | 8 937 249,89          | CAD                  | -8 931 911,63          |
| V/CHF/EUR/20240906 | 99 536,92                          |                    | EUR                         | 14 762 344,84         | CHF                  | -14 662 807,92         |
| V/CHF/EUR/20240906 | 20 390,88                          |                    | EUR                         | 3 377 226,43          | CHF                  | -3 356 835,55          |
| V/CNH/EUR/20240906 | 9 345,94                           |                    | EUR                         | 4 620 088,81          | CNH                  | -4 610 742,87          |
| V/EUR/AUD/20240906 | 4 107,93                           |                    | AUD                         | 1 147 806,58          | EUR                  | -1 143 698,65          |
| V/EUR/AUD/20240906 | 17 930,50                          |                    | AUD                         | 5 109 670,99          | EUR                  | -5 091 740,49          |
| V/EUR/CAD/20240906 |                                    | -5 364,72          | CAD                         | 4 876 069,69          | EUR                  | -4 881 434,41          |
| V/EUR/CHF/20240906 |                                    | -23 767,79         | CHF                         | 3 895 955,56          | EUR                  | -3 919 723,35          |
| V/EUR/GBP/20240906 |                                    | -1 918,77          | GBP                         | 1 062 687,98          | EUR                  | -1 064 606,75          |
| V/EUR/JPY/20240906 |                                    | -52 664,21         | JPY                         | 7 617 030,46          | EUR                  | -7 669 694,67          |
| V/EUR/MXN/20240906 |                                    | -45 855,11         | MXN                         | 4 694 488,31          | EUR                  | -4 740 343,42          |
| V/EUR/NOK/20240906 |                                    | -46 143,05         | NOK                         | 5 436 358,06          | EUR                  | -5 482 501,11          |
| V/EUR/NOK/20240906 |                                    | -93 937,32         | NOK                         | 12 767 734,30         | EUR                  | -12 861 671,62         |
| V/EUR/NZD/20240906 |                                    | -14 596,79         | NZD                         | 3 076 441,99          | EUR                  | -3 091 038,78          |
| V/EUR/SEK/20240906 |                                    | -22 630,55         | SEK                         | 2 736 123,35          | EUR                  | -2 758 753,90          |
| V/EUR/SEK/20240906 |                                    | -19 488,90         | SEK                         | 1 752 422,91          | EUR                  | -1 771 911,81          |
| V/EUR/USD/20240906 |                                    | -3 585,44          | USD                         | 2 902 729,18          | EUR                  | -2 906 314,62          |
| V/EUR/USD/20240906 | 613,22                             |                    | USD                         | 18 024 725,92         | EUR                  | -18 024 112,70         |
| V/NOK/EUR/20240906 | 17 915,61                          |                    | EUR                         | 2 894 925,02          | NOK                  | -2 877 009,41          |
| V/NZD/EUR/20240906 | 1 679,90                           |                    | EUR                         | 370 588,08            | NZD                  | -368 908,18            |
| V/SEK/EUR/20240906 | 22 822,58                          |                    | EUR                         | 2 410 010,31          | SEK                  | -2 387 187,73          |
| V/USD/EUR/20240906 | 1 094,54                           |                    | EUR                         | 1 816 333,00          | USD                  | -1 815 238,46          |
| V/ZAR/EUR/20240906 | 19 745,38                          |                    | EUR                         | 1 721 436,35          | ZAR                  | -1 701 690,97          |
| <b>Total</b>       | <b>226 438,69</b>                  | <b>-355 709,13</b> |                             | <b>127 423 842,89</b> |                      | <b>-127 553 113,33</b> |

(\*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions exprimé dans la devise de comptabilisation.

# FCP HSBC MIX DYNAMIQUE

## Inventaire des instruments financiers à terme

### Inventaire des instruments financiers à terme - actions

| Nature d'engagements | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |            | Montant de l'exposition (*) |
|----------------------|---------------------|------------------------------------|------------|-----------------------------|
|                      |                     | Actif                              | Passif     | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>    |                     |                                    |            |                             |
| AEX FUT 0724         | 9                   |                                    | -854,00    | 1 667 196,00                |
| CAC 40 FUT 0724      | 15                  |                                    | -25 600,00 | 1 123 875,00                |
| CONSUMER DISC 0924   | -9                  |                                    | -22 066,71 | -1 565 290,41               |
| DAX 30 IND FU 0924   | -11                 |                                    | -46 312,50 | -5 060 825,00               |
| DJE 600 BANK 0924    | 169                 | 23 238,00                          |            | 1 649 440,00                |
| DJE 600 EUROP 0924   | -272                |                                    | -12 240,00 | -6 993 120,00               |
| DJE 600 INSUR 0924   | 88                  | 13 155,00                          |            | 1 656 600,00                |
| DJES BANKS 0924      | 232                 | 35 960,00                          |            | 1 595 580,00                |
| DJE SML200 0924      | 281                 |                                    | -21 075,00 | 4 710 965,00                |
| DJS 600 CHEM 0924    | -78                 | 11 700,00                          |            | -4 917 510,00               |
| DJS BAS R FUT 0924   | -139                |                                    | -48 310,00 | -4 047 680,00               |
| DJS F&B FUT 0924     | -46                 | 51 290,00                          |            | -1 580 560,00               |
| DJS TECH FUT 0924    | 19                  | 1 995,00                           |            | 852 625,00                  |
| DJS TELECOM 0924     | -161                |                                    | -2 410,00  | -1 660 715,00               |
| DJ STOXX HC 0924     | -14                 | 350,00                             |            | -850 220,00                 |
| DJS TRAVEL 0924      | 70                  | 9 100,00                           |            | 821 800,00                  |
| E-MIN RUS 200 0924   | -17                 |                                    | -28 472,13 | -1 637 742,01               |
| EURO STOXX 50 0924   | -229                | 48 097,50                          |            | -11 280 540,00              |
| FCI FTSE Burs 0724   | -106                | 3 614,52                           |            | -1 673 546,28               |
| FTSE/MIB 0924        | 20                  | 39 200,00                          |            | 3 336 600,00                |
| FTSEJSE TOP40 0924   | 43                  | 8 122,57                           |            | 1 620 276,80                |
| FTSE TAIWAN I 0724   | 23                  | 3 732,21                           |            | 1 655 656,64                |
| HANG SENG TEC 0724   | 87                  |                                    | -43 668,44 | 1 855 388,64                |
| HHI HANG SENG 0724   | 42                  |                                    | -9 787,75  | 1 572 314,64                |
| IFSC NIFTY 50 0724   | -20                 |                                    | -16 928,39 | -900 937,72                 |
| KOSPI2 INDEX 0924    | -27                 |                                    | -69 546,88 | -1 767 726,10               |
| MEFF IBEX35 E 0724   | 45                  | 13 162,50                          |            | 4 894 200,00                |
| MEX BOLSA IDX 0924   | -62                 |                                    | -10 313,59 | -1 687 853,27               |
| MSCI CHIN A50 0724   | 37                  |                                    | -15 348,73 | 1 665 388,38                |
| MSCI EMG MKT 0924    | -54                 |                                    | -22 673,20 | -2 741 441,57               |
| MSCI ID NTR 0924     | 112                 | 94 971,40                          |            | 1 720 625,15                |
| OMX COP25 100 0724   | 27                  |                                    | -3 167,97  | 709 082,86                  |
| OMXS30 FUT 0724      | 239                 | 9 608,99                           |            | 5 428 563,88                |
| OSE TOPIX FUT 0924   | -15                 |                                    | -30 887,17 | -2 445 306,51               |
| S&P TORONTO 6 0924   | -14                 |                                    | -24 533,77 | -2 502 062,66               |
| SET50 FUTURES 0924   | -612                | 6 060,43                           |            | -2 499 315,16               |

# FCP HSBC MIX DYNAMIQUE

## Inventaire des instruments financiers à terme - actions

| Nature d'engagements            | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |                    | Montant de l'exposition (*) |
|---------------------------------|---------------------|------------------------------------|--------------------|-----------------------------|
|                                 |                     | Actif                              | Passif             | +/-                         |
| SP 500 MINI 0924                | 107                 | 93 846,51                          |                    | 27 562 421,27               |
| SP E-MINI FIN 0924              | 14                  | 19 920,69                          |                    | 1 672 521,58                |
| SP E-MINI HEA 0924              | -24                 |                                    | -1 791,46          | -3 335 479,36               |
| SP E-MINI MAT 0924              | -19                 | 7 044,55                           |                    | -1 680 261,25               |
| SP EMIN UTILI 0924              | -25                 | 32 591,56                          |                    | -1 621 180,31               |
| SPI 200 FUT 0924                | -28                 |                                    | -23 772,43         | -3 390 079,76               |
| ST600 RETAIL 0924               | 77                  |                                    | -28 010,00         | 1 641 640,00                |
| STOXX 600 FIN 0924              | 129                 |                                    | -42 380,00         | 4 893 615,00                |
| XAE ENERGY SE 0924              | 19                  | 68 961,98                          |                    | 1 711 817,12                |
| XAK TECHNOLOG 0924              | 9                   |                                    | -13 100,07         | 1 938 306,51                |
| XEUR FSMI SWI 0924              | 9                   |                                    | -4 392,30          | 1 123 586,52                |
| XEUR FSTN DJ 0924               | 24                  |                                    | -11 300,00         | 804 360,00                  |
| XEUR FSTU DJ 0924               | 44                  |                                    | -2 240,00          | 810 040,00                  |
| <b>Sous-total 1.</b>            |                     | <b>595 723,41</b>                  | <b>-581 182,49</b> | <b>14 855 093,62</b>        |
| <b>2. Options</b>               |                     |                                    |                    |                             |
| EURO STOXX 50 09/2024 CALL 5250 | 710                 | 138 450,00                         |                    | 4 864 655,88                |
| EURO STOXX 50 12/2024 PUT 4600  | 450                 | 429 750,00                         |                    | -5 505 772,50               |
| <b>Sous-total 2.</b>            |                     | <b>568 200,00</b>                  |                    | <b>-641 116,62</b>          |
| <b>3. Swaps</b>                 |                     |                                    |                    |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>            |                     |                                    |                    |                             |
| <b>4. Autres instruments</b>    |                     |                                    |                    |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>            |                     |                                    |                    |                             |
| <b>Total</b>                    |                     | <b>1 163 923,41</b>                | <b>-581 182,49</b> | <b>14 213 977,00</b>        |

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

# FCP HSBC MIX DYNAMIQUE

## Inventaire des instruments financiers à terme - taux d'intérêts

| Nature d'engagements         | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |                    | Montant de l'exposition (*) |
|------------------------------|---------------------|------------------------------------|--------------------|-----------------------------|
|                              |                     | Actif                              | Passif             | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |                    |                             |
| AUST 10Y BOND 0924           | 26                  |                                    | -28 909,32         | 1 839 975,83                |
| CBOT USUL 30A 0924           | -9                  |                                    | -8 659,90          | -1 052 571,73               |
| EURO BOBL 0924               | -203                |                                    | -211 120,00        | -23 637 320,00              |
| EURO BUND 0924               | 306                 | 476 270,00                         |                    | 40 275 720,00               |
| EURO-OAT 0924                | -42                 | 51 660,00                          |                    | -5 171 040,00               |
| EURO SCHATZ 0924             | 339                 | 159 330,00                         |                    | 35 832 300,00               |
| LIFFE LG GILT 0924           | 58                  | 17 408,74                          |                    | 6 674 600,46                |
| MSE CANADA 10 0924           | 65                  | 42 105,62                          |                    | 5 321 707,41                |
| SIMEX MINIJGB 0924           | -112                |                                    | -5,80              | -9 272 391,17               |
| TU CBOT UST 2 0924           | 428                 | 178 563,10                         |                    | 81 554 117,10               |
| US 10Y ULT 0924              | -82                 |                                    | -32 306,97         | -8 686 319,10               |
| XEUR FGBX BUX 0924           | -104                |                                    | -223 840,00        | -13 544 960,00              |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     | <b>925 337,46</b>                  | <b>-504 841,99</b> | <b>110 133 818,80</b>       |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |                    |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     |                                    |                    |                             |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |                    |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     |                                    |                    |                             |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |                    |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     |                                    |                    |                             |
| <b>Total</b>                 |                     | <b>925 337,46</b>                  | <b>-504 841,99</b> | <b>110 133 818,80</b>       |

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

# FCP HSBC MIX DYNAMIQUE

## Inventaire des instruments financiers à terme - de change

| Nature d'engagements         | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|------------------------------|---------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
|                              |                     | Actif                              | Passif | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>Total</b>                 |                     |                                    |        |                             |

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

## Inventaire des instruments financiers à terme - sur risque de crédit

| Nature d'engagements         | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|------------------------------|---------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
|                              |                     | Actif                              | Passif | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>Total</b>                 |                     |                                    |        |                             |

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

# FCP HSBC MIX DYNAMIQUE

## Inventaire des instruments financiers à terme - autres expositions

| Nature d'engagements         | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|------------------------------|---------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
|                              |                     | Actif                              | Passif | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |        |                             |
| SP EMINI COM 0924            | 31                  | 57 487,75                          |        | 3 277 163,52                |
| TPX BANKS 0924               | 122                 | 85 448,69                          |        | 2 484 557,87                |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     | <b>142 936,44</b>                  |        | <b>5 761 721,39</b>         |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     |                                    |        |                             |
| <b>Total</b>                 |                     | <b>142 936,44</b>                  |        | <b>5 761 721,39</b>         |

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

## Inventaire des instruments financiers à terme ou des opérations à terme de devises utilisés en couverture d'une catégorie de part

L'OPC sous revue n'est pas concerné par cette rubrique.

# FCP HSBC MIX DYNAMIQUE

## Synthèse de l'inventaire

|  | Valeur actuelle présentée au bilan |
|--|------------------------------------|
| Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)                          | 205 152 323,98                     |
| Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :               |                                    |
| Total opérations à terme de devises  | -129 270,44                        |
| Total instruments financiers à terme - actions                                       | 582 740,92                         |
| Total instruments financiers à terme - taux  | 420 495,47                         |
| Total instruments financiers à terme - change  |                                    |
| Total instruments financiers à terme - crédit  |                                    |
| Total instruments financiers à terme - autres expositions                            | 142 936,44                         |
| Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises |                                    |
| Autres actifs (+)  | 14 174 044,44                      |
| Autres passifs (-)   | -1 034 676,47                      |
| Passifs de financement (-)   |                                    |
| <b>Total = actif net</b>   | <b>219 308 594,34</b>              |

| Libellé de la part        | Devise de la part | Nombre de parts | Valeur liquidative |
|---------------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| Part HSBC MIX DYNAMIQUE A | EUR               | 329 681,216     | 444,87             |
| Part HSBC MIX DYNAMIQUE I | EUR               | 52 423,447      | 1 385,69           |