

Asset Management

**FCPE  
HSBC EE MODÉRÉ**

Rapport semestriel  
au 30 juin 2023

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



# FCPE HSBC EE MODÉRÉ

## 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	277 959,06
c) Autres actifs détenus par l'OPC	101 171 429,62
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	101 449 388,68
e) Passif	-146 438,80
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	101 302 949,88

\* Les montants sont signés

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

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
HSBC EE MODERE E en EUR	C	23 815 494,69	4 898 762,13240	4,861
HSBC EE MODERE F en EUR	C	58 225 693,67	13 763 841,36750	4,230
HSBC EE MODERE G en EUR	C	19 261 761,52	2 046 030,55450	9,414

# FCPE HSBC EE MODÉRÉ

## 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.	99,87	99,73

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

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

# FCPE HSBC EE MODÉRÉ

## 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 MODÉRÉ

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

<b>Pays</b>	<b>Pourcentage actif net *</b>	<b>Pourcentage total des actifs **</b>
NEANT		

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

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

# FCPE HSBC EE MODÉRÉ

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

Nature d'actifs	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
OPC Maître	99,87	99,73
Autres		
TOTAL	99,87	99,73

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

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

# FCPE HSBC EE MODÉRÉ

## 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.	4 486 497,77	5 547 527,00

# FCPE HSBC EE MODÉRÉ

## 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 MODÉRÉ

## **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 DICI 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 documentées 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 : 99,85%.

- Montant total du levier calculé selon la méthode de l'engagement : 99,85%.

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

# FCPE HSBC EE MODÉRÉ

## Portefeuille titres au 30/06/2023 en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Organismes de placement collectif</b>				
<b>Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres UE et organismes de titrisation non cotés</b>				
<b>FRANCE</b>				
HSBC MIX MODERE I	EUR	93 532,397	101 171 187,86	99,87
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>101 171 187,86</b>	<b>99,87</b>
<b>TOTAL Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres UE et organismes de titrisation non cotés</b>			<b>101 171 187,86</b>	<b>99,87</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>101 171 187,86</b>	<b>99,87</b>
<b>Créances</b>			<b>241,76</b>	
<b>Dettes</b>			<b>-146 438,80</b>	<b>-0,14</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>277 959,06</b>	<b>0,27</b>
<b>Actif net</b>			<b>101 302 949,88</b>	<b>100,00</b>

Asset Management

# FCP de droit français HSBC MIX MODERE

## Rapport semestriel au 30 juin 2023

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



# FCP HSBC MIX MODERE

## 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	104 820 226,63
b) Avoirs bancaires	8 802 434,95
c) Autres actifs détenus par l'OPC	158 193 112,57
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	271 815 774,15
e) Passif	-48 134 162,23
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	223 681 611,92

\* Les montants sont signés

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

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
HSBC MIX MODERE A en EUR	C	106 019 256,49	342 970,04700	309,12
HSBC MIX MODERE I en EUR	C	117 662 355,43	108 777,68200	1 081,67

# FCP HSBC MIX MODERE

## 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.	45,52	37,46
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.	1,34	1,10
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.	46,67	38,41

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

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

# FCP HSBC MIX MODERE

## 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 **
Euro	EUR	99 428 617,61	44,45	36,58
Yen Japonais	JPY	2 991 012,34	1,34	1,10
Couronne Suédoise	SEK	2 400 596,68	1,07	0,88
TOTAL		104 820 226,63	46,86	38,56

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

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

# FCP HSBC MIX MODERE

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 **
LUXEMBOURG	8,79	7,23
ALLEMAGNE	8,36	6,88
ESPAGNE	8,04	6,62
FRANCE	6,45	5,31
BELGIQUE	3,81	3,14
ITALIE	3,10	2,55
PAYS-BAS	2,99	2,46
AUTRICHE	2,35	1,93
JAPON	1,34	1,10
SUEDE	1,07	0,88
PORTUGAL	0,55	0,45
TOTAL	46,86	38,56

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

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

# FCP HSBC MIX MODERE

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

Nature d'actifs	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
<b>Organismes de placement collectif</b>		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	46,67	38,41
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE		
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés		
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés		
Autres organismes non européens		
<b>Autres actifs</b>		
Autres		
<b>TOTAL</b>	<b>46,67</b>	<b>38,41</b>

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

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

# FCP HSBC MIX MODERE

## 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.	12 290 119,83	10 338 128,24
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.		
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.	34 532 780,57	45 339 254,07

# FCP HSBC MIX MODERE

## **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 MODERE

## Portefeuille titres au 30/06/2023 en EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Obligations et valeurs assimilées</b>				
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
FMS 0.375% 29-04-30 EMTN	EUR	800 000	668 676,98	0,30
KFW 0.625% 07-01-28	EUR	7 725 000	6 951 209,50	3,11
KFW 1.125% 15-09-32 EMTN	EUR	12 800 000	11 090 944,00	4,96
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>18 710 830,48</b>	<b>8,37</b>
<b>AUTRICHE</b>				
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.9% 20-02-32	EUR	6 200 000	5 248 542,48	2,35
<b>TOTAL AUTRICHE</b>			<b>5 248 542,48</b>	<b>2,35</b>
<b>BELGIQUE</b>				
COMMUNAUTE EUROPEAN BRU 0.3% 04-11-50	EUR	2 030 000	1 000 818,50	0,44
EUROPEAN UNION 0.0% 22-04-31	EUR	6 000 000	4 767 120,00	2,14
EUROPEAN UNION 0.2% 04-06-36	EUR	740 000	510 658,41	0,22
EUROPEAN UNION 1.0% 06-07-32	EUR	1 800 000	1 542 568,56	0,70
EUROPEAN UNION 3.0% 04-03-53	EUR	730 000	709 642,90	0,32
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>8 530 808,37</b>	<b>3,82</b>
<b>ESPAGNE</b>				
SPAIN GOVERNMENT BOND 0.7% 30-04-32	EUR	18 700 000	15 052 530,77	6,73
SPAIN GOVERNMENT BOND 1.9% 31-10-52	EUR	4 350 000	2 940 101,84	1,31
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>17 992 632,61</b>	<b>8,04</b>
<b>FRANCE</b>				
BPIFRANCE FINANCEMENT 0.05% 26-09-29	EUR	1 200 000	988 799,92	0,44
COUNCIL OF EUROPE DEVELOPMENT BANK 0.0% 20-01-31	EUR	9 250 000	7 367 301,25	3,29
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.0% 25-05-32	EUR	2 000 000	1 555 770,00	0,70
LA POSTE 0.0000010% 18-07-29	EUR	1 200 000	960 444,00	0,43
SNCF RESEAU 0.75% 25-05-36	EUR	2 700 000	1 953 341,11	0,87
SOCIETE DU GRAND PARIS 0.875% 10-05-46	EUR	1 200 000	688 979,87	0,31
SOCIETE NATLE SNCF 3.125% 02-11-27	EUR	900 000	906 498,37	0,41
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>14 421 134,52</b>	<b>6,45</b>
<b>ITALIE</b>				
ITALY 1.65% 01-03-32	EUR	3 260 000	2 754 177,16	1,23
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.95% 01-03-37	EUR	2 600 000	1 761 972,95	0,79
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.95% 01-12-31	EUR	3 050 000	2 421 796,25	1,08
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>6 937 946,36</b>	<b>3,10</b>
<b>JAPON</b>				
JAPAN 30 YEAR ISSUE 1.0% 20-03-52	JPY	500 000 000	2 991 012,34	1,34
<b>TOTAL JAPON</b>			<b>2 991 012,34</b>	<b>1,34</b>

# FCP HSBC MIX MODERE

## Portefeuille titres au 30/06/2023 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>LUXEMBOURG</b>				
BANQUE EUROPEAN DINVESTISSEM 1.0% 14-03-31	EUR	6 775 000	5 864 643,99	2,62
BANQUE EUROPEAN DINVESTISSEMENT 0.01% 15-11-35	EUR	9 000 000	6 169 709,59	2,76
BANQUE EUROPEAN D INVESTISSEMENT 0.2% 17-03-36	EUR	2 093 000	1 459 219,99	0,65
BANQUE EUROPEAN DINVESTISSEMENT 1.125% 13-04-33	EUR	5 118 000	4 312 531,68	1,93
EUROPEAN STABILITY MECHANISM 0.01% 15-10-31	EUR	1 250 000	977 595,98	0,43
EUROPEAN STABILITY MECHANISM 3.0% 23-08-33	EUR	875 000	875 176,80	0,39
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>19 658 878,03</b>	<b>8,78</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
BNG BANK NV 0.0% 20-01-31 EMTN	EUR	4 060 000	3 220 777,70	1,44
BNG BANK NV 0.25% 12-01-32	EUR	2 950 000	2 327 535,05	1,04
NEDWBK 0.25% 19-01-32 EMTN	EUR	1 450 000	1 144 074,63	0,51
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>6 692 387,38</b>	<b>2,99</b>
<b>PORTUGAL</b>				
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 1.95% 15-06-29	EUR	0,01	0,01	
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 2.25% 18-04-34	EUR	1 350 000	1 235 457,37	0,55
<b>TOTAL PORTUGAL</b>			<b>1 235 457,38</b>	<b>0,55</b>
<b>SUEDE</b>				
KINGDOM OF SWEDEN 0.125% 12-05-31	SEK	34 230 000	2 400 596,68	1,07
<b>TOTAL SUEDE</b>			<b>2 400 596,68</b>	<b>1,07</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>104 820 226,63</b>	<b>46,86</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées</b>			<b>104 820 226,63</b>	<b>46,86</b>
<b>Organismes de placement collectif</b>				
<b>OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>				
<b>FRANCE</b>				
HSBC EURO ACTIONS ZC	EUR	1 485,966	2 305 179,06	1,03
HSBC EURO EQUITY VOLATILITY FOCUSED Z	EUR	3 302,781	4 439 433,08	1,98
HSBC Europe Equity Quality Income Z	EUR	50,262	911 669,75	0,41
HSBC EURO PME PART Z	EUR	661,787	918 997,14	0,41
HSBC RIF SRI EUROLAND EQUITY Z	EUR	8 958,756	1 132 118,00	0,51
HSBC SRI MONEY ZC	EUR	2 522,068	3 486 756,74	1,56
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>13 194 153,77</b>	<b>5,90</b>
<b>IRLANDE</b>				
HSBC FTSE 100 ETF	GBP	12 212	1 075 265,07	0,48
HSBC GBF ICAV MLTFAC E E ZC	EUR	1 874 861,902	21 155 941,70	9,45
HSBC MSCI CANADA ETF	EUR	37 459	721 198,13	0,32
HSBC MSCI JAPAN	EUR	43 466	1 430 031,40	0,64
HSBC MSCI PACIFIC EX JAPAN UCITS ETF USD	EUR	54 294	654 894,23	0,30

# FCP HSBC MIX MODERE

## Portefeuille titres au 30/06/2023 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ISHARES BLOOMBERG ROLL SELECT COMMODITY SWAP UCITS ETF	USD	703 375	4 420 431,43	1,98
PASSIM STR CRS AST TRD STR B	EUR	55 407,2352	6 035 510,13	2,70
SPDR SP 500 Low Volatility UCITS ETF	EUR	40 161	2 500 022,25	1,11
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>37 993 294,34</b>	<b>16,98</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
EUROLAND GROWTH ZC	EUR	135 464,111	2 654 554,72	1,19
Global Emerging Markets Local Debt Z Cap	USD	212 226,287	2 084 914,15	0,93
HSBC EUROLAND EQ.SMALLER Z C.	EUR	25 505,76	2 455 388,50	1,10
HSBC EUROLAND EQUITY Z CAP.	EUR	17 522,112	1 244 525,53	0,56
HSBC GI CHIN EQ ZC	USD	4 082,534	365 643,12	0,16
HSBC GIF-BRAZIL EQUITY-ZA	USD	39 378,607	858 713,51	0,39
HSBC GIF-EURO CREDIT BD-ZC	EUR	692 118,139	7 195 952,29	3,22
HSBC GIF MULTI ASSET STYLE FACTORS ZC	EUR	321 329,983	3 607 250,39	1,61
HSBC GL EURO CREDIT BD TR ZC	EUR	1 978 862,94	23 601 898,29	10,55
HSBC GL INV-IND FIX IN-ZD	USD	168 138,859	1 332 473,48	0,59
HSBC GLOBAL INVESTMENT FUNDS ASIA HIGH YIELD BOND ZC	USD	521 302,896	3 357 649,36	1,50
HSBC Global Investment Funds Global Emerging Markets Bond Z	USD	160 461,355	2 174 832,32	0,97
STRUCTURED INVESTMENTS SICAV GS CROSS ASSET TREND PORTFOLIO	EUR	208 113,718	2 275 869,19	1,02
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>53 209 664,85</b>	<b>23,79</b>
<b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>			<b>104 397 112,96</b>	<b>46,67</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>104 397 112,96</b>	<b>46,67</b>
<b>Instrument financier à terme</b>				
<b>Engagements à terme fermes</b>				
<b>Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé</b>				
AEX FUT 0723	EUR	-11	-23 892,00	-0,01
AUST 10Y BOND 0923	AUD	42	-11 721,82	-0,01
CAC 40 FUT 0723	EUR	-8	-11 896,00	-0,01
CBOT USUL 30A 0923	USD	-65	-61 633,54	-0,03
CONSUMER DISC 0923	USD	-4	-27 277,73	-0,01
DAX 30 IND FU 0923	EUR	-4	-8 100,00	-0,01
DJE 600 BANK 0923	EUR	80	13 300,00	
DJE 600 EUROP 0923	EUR	-117	-1 170,00	
DJE 600 INDUS 0923	EUR	-17	2 975,00	0,01
DJE 600 INSUR 0923	EUR	-17	730,00	
DJE 600 OIL G 0923	EUR	84	-17 135,00	-0,01
DJES BANKS 0923	EUR	90	21 700,00	0,01

# FCP HSBC MIX MODERE

## Portefeuille titres au 30/06/2023 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
DJS 600 CHEM 0923	EUR	-19	-20 710,00	-0,01
DJS 600 MED 0923	EUR	-28	7 300,00	
DJS BAS R FUT 0923	EUR	45	-55 640,00	-0,02
DJS F&B FUT 0923	EUR	-28	-5 040,00	
DJS TELECOM 0923	EUR	84	7 980,00	0,01
DJ STOXX HC 0923	EUR	11	-10 120,00	
DJ STX600 AUT 0923	EUR	29	10 730,00	
E-MIN RUS 200 0923	USD	-20	-15 811,18	
EURO BOBL 0923	EUR	-201	122 590,00	0,05
EURO BUND 0923	EUR	-28	70,00	
EURO SCHATZ 0923	EUR	501	-194 130,00	-0,09
EURO STOXX 50 0923	EUR	-154	-49 865,00	-0,03
FCI FTSE Burs 0723	MYR	-42	5 154,94	0,01
FTSE/MIB 0923	EUR	20	82 550,00	0,04
FTSE 100 FUT 0923	GBP	19	-11 367,48	
FTSEJSE TOP40 0923	ZAR	15	-8 733,48	-0,01
HANG SENG TEC 0723	HKD	30	2 280,78	
HHI HANG SENG 0723	HKD	29	4 918,30	
IN NSE SP CN 0723	USD	-9	-7 678,28	
LIFFE LG GILT 0923	GBP	-4	-885,63	
MEFF IBEX35 E 0723	EUR	18	43 848,00	0,02
MEX BOLSA IDX 0923	MXN	-19	10 806,36	
MME MSCI EMER 0923	USD	-18	9 816,68	
MSCI CHIN A50 0723	USD	16	1 017,42	
MSCI ID NTR 0923	USD	34	-7 246,93	
MSE CANADA 10 0923	CAD	138	-39 253,31	-0,02
OMX COP25 100 0723	DKK	8	-1 036,81	
OMXS30 FUT 0723	SEK	-106	6 071,66	0,01
OSE TOPIX FUT 0923	JPY	-1	-3 995,24	
SET50 FUTURES 0923	THB	-57	-2 659,16	-0,01
SIMEX MINIJGB 0923	JPY	-188	-72 586,51	-0,04
SP 500 MINI 0923	USD	29	148 515,12	0,07
SP EMINI COM 0923	USD	-4	-7 882,68	
SP E-MINI FIN 0923	USD	-13	-16 475,71	-0,01
SP E-MIN INDU 0923	USD	9	42 153,99	0,02
SP EMIN UTILI 0923	USD	-14	10 242,90	0,01
SPI 200 FUT 0923	AUD	16	17 236,12	0,01
ST600 RETAIL 0923	EUR	48	48 480,00	0,02
STOXX 600 FIN 0923	EUR	-19	16 245,00	0,01

# FCP HSBC MIX MODERE

## Portefeuille titres au 30/06/2023 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
STOXX 600 P&H 0923	EUR	29	37 845,00	0,01
TPX BANKS 0923	JPY	99	78 038,43	0,04
TU CBOT UST 2 0923	USD	723	-1 292 127,35	-0,58
US 10Y ULT 0923	USD	-44	-1 546,75	
XAE ENERGY SE 0923	USD	10	9 853,35	
XAK TECHNOLOG 0923	USD	17	80 247,48	0,03
XAPXAP CONSUM 0923	USD	18	26 397,80	0,01
XEUR FGBX BUX 0923	EUR	-116	-426 880,00	-0,19
XEUR FOAT EUR 0923	EUR	15	-2 850,00	
XEUR FSMI SWI 0923	CHF	-18	4 057,17	0,01
XEUR FSTU DJ 0923	EUR	-31	-1 980,00	
<b>TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé</b>			<b>-1 546 176,09</b>	<b>-0,69</b>
<b>TOTAL Engagements à terme fermes</b>			<b>-1 546 176,09</b>	<b>-0,69</b>
<b>Engagements à terme conditionnels</b>				
<b>Engagements à terme conditionnels sur marché réglementé</b>				
VSTOXX 09/2023 CALL 20	EUR	1 000	-51 500,00	-0,02
VSTOXX 09/2023 PUT 16	EUR	-1 000	-45 000,00	-0,02
<b>TOTAL Engagements à terme conditionnels sur marché réglementé</b>			<b>-96 500,00</b>	<b>-0,04</b>
<b>TOTAL Engagements à terme conditionnels</b>			<b>-96 500,00</b>	<b>-0,04</b>
<b>TOTAL Instrument financier à terme</b>			<b>-1 642 676,09</b>	<b>-0,73</b>
<b>Appel de marge</b>				
Appel Marge CACEIS	THB	102 859,99	2 659,16	
APPEL MARGE CACEIS	HKD	-61 549,99	-7 199,08	
APPEL MARGE CACEIS	CHF	-3 960	-4 057,17	-0,01
APPEL MARGE CACEIS	SEK	-71 549,99	-6 071,66	
APPEL MARGE CACEIS	JPY	-229 700	-1 456,68	
APPEL MARGE CACEIS	GBP	10 515	12 253,10	0,01
APPEL MARGE CACEIS	AUD	-9 037,94	-5 514,30	
APPEL MARGE CACEIS	ZAR	180 000,1	8 733,48	
APPEL MARGE CACEIS	USD	1 210 393,68	1 109 435,09	0,49
APPEL MARGE CACEIS	MYR	-26 250,02	-5 154,95	
APPEL MARGE CACEIS	CAD	56 670	39 253,31	0,02
APPEL MARGE CACEIS	MXN	-202 200	-10 806,36	
APPEL MARGE CACEIS	EUR	509 565	509 565,00	0,22
APPEL MARGE CACEIS	DKK	7 720	1 036,81	
<b>TOTAL Appel de marge</b>			<b>1 642 675,75</b>	<b>0,73</b>

# FCP HSBC MIX MODERE

## Portefeuille titres au 30/06/2023 en EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Créances</b>			<b>51 239 912,16</b>	<b>22,91</b>
<b>Dettes</b>			<b>-45 578 074,44</b>	<b>-20,38</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>8 802 434,95</b>	<b>3,94</b>
<b>Actif net</b>			<b>223 681 611,92</b>	<b>100,00</b>