

# **LA FRANCAISE OBLIGATIONS LT**

Fonds Commun de Placement

Société de Gestion :  
Credit Mutuel Asset Management

4, rue Gaillon  
75002 Paris

---

## **Attestation du Commissaire aux Comptes relative à la composition de l'actif**

au 28 juin 2024

## LA FRANCAISE OBLIGATIONS LT

Fonds Commun de Placement

Société de Gestion :  
Credit Mutuel Asset Management

4, rue Gaillon  
75002 Paris

### Attestation du Commissaire aux Comptes relative à la composition de l'actif

au 28 juin 2024

---

En notre qualité de commissaire aux comptes du Fonds Commun de Placement LA FRANCAISE OBLIGATIONS LT et en application des dispositions prévues par l'article L 214-17 du Code monétaire et financier relatives au contrôle de la composition de l'actif, nous avons établi la présente attestation sur les informations figurant dans la composition de l'actif au 28 juin 2024 ci-jointe.

Ces informations ont été établies sous la responsabilité de la société de gestion. Il nous appartient de nous prononcer sur la cohérence des informations contenues dans la composition de l'actif avec la connaissance que nous avons du FCP LA FRANCAISE OBLIGATIONS LT acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Nous avons mis en œuvre les diligences que nous avons estimé nécessaires au regard de la doctrine professionnelle de la Compagnie nationale des commissaires aux comptes relative à cette intervention. Ces diligences, qui ne constituent ni un audit ni un examen limité, ont consisté essentiellement à réaliser des procédures analytiques et des entretiens avec les personnes qui produisent et contrôlent les informations données.

Sur la base de nos travaux, nous n'avons pas d'observation à formuler sur la cohérence des informations figurant dans le document joint avec la connaissance que nous avons du FCP LA FRANCAISE OBLIGATIONS LT acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

A Paris La Défense, le 14 août 2024

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés



Virginie GAITTE

Fonds: LF OBLIGATIONS LT (PFP025) EUR

Date de VL: 28/06/2024

| Classe (VL) | Code ISIN Part | Actif Net Part en<br>Dev. de Réf. | Nb. Parts         | Disponibilités | VL (dev part) 6/28/24 | VL préc. (dev part)<br>6/27/24 | Var. VL (%) | Statut |
|-------------|----------------|-----------------------------------|-------------------|----------------|-----------------------|--------------------------------|-------------|--------|
| I cap       | FR0000425241   | 25,639,534.290000                 | 84,821.8121000000 | 253,979.34     | 302.270000            | 302.99                         | -0.24       | VAL    |
| S cap       | FR0010955468   | 19,960,422.580000                 | 1,644.8285900000  | 253,979.34     | 12,135.250000         | 12,163.78                      | -0.23       | VAL    |

| Code valeur | Lib. court valeur                                                 | Libellé type<br>instrument | Quantité            | Dev<br>cot | S/C | PRU (dev cot) | Cours | Dt cours | Orig | PRT (dev réf) | VBT (dev réf) | CCT (dev réf) | PMVT (dev réf) | Actif net |
|-------------|-------------------------------------------------------------------|----------------------------|---------------------|------------|-----|---------------|-------|----------|------|---------------|---------------|---------------|----------------|-----------|
| 3510000     | Appels de marge                                                   | Disponibilités             | -84,998.0000000000  | EUR        |     |               |       |          |      |               | -84,998.00    |               |                | -0.1864   |
| 4030590     | Prov frais RTO                                                    | Disponibilités             | -1,329.0000000000   |            |     |               |       |          |      |               | -1,329.00     |               |                | -0.0029   |
| 4161004     | Ctie cash donne en garantie                                       | Disponibilités             | 132,696.7000000000  |            |     |               |       |          |      |               | 132,696.70    |               |                | 0.2910    |
| 4410000     | Taxes en attente<br>recuperation                                  | Disponibilités             | 13,562.5000000000   |            |     |               |       |          |      |               | 13,562.50     |               |                | 0.0297    |
| 4630100     | Frais et commissions a<br>payer                                   | Disponibilités             | -320.0000000000     |            |     |               |       |          |      |               | -320.00       |               |                | -0.0007   |
| 4640000     | FDG fonct A-1 a payer                                             | Disponibilités             | -2,800.0800000000   |            |     |               |       |          |      |               | -2,800.08     |               |                | -0.0061   |
| 4643000     | FDG depositaire N-1 a<br>payer                                    | Disponibilités             | 3,780.0500000000    |            |     |               |       |          |      |               | 3,780.05      |               |                | 0.0083    |
| 4643100     | FDG depositaire A-1 a payer                                       | Disponibilités             | -3,780.0500000000   |            |     |               |       |          |      |               | -3,780.05     |               |                | -0.0083   |
| 4644100     | FDG Hon CAC A-1 a payer                                           | Disponibilités             | -0.8600000000       |            |     |               |       |          |      |               | -0.86         |               |                | 0.0000    |
| 4660000     | Reliquat FDG fonct                                                | Disponibilités             | 5,399.7900000000    |            |     |               |       |          |      |               | 5,399.79      |               |                | 0.0118    |
| 4662000     | Reliquat FDG valorisateur                                         | Disponibilités             | 631.2200000000      |            |     |               |       |          |      |               | 631.22        |               |                | 0.0014    |
| 4663000     | Reliquat FDG depositaire<br>Controparte Debito da<br>equalizz. 46 | Disponibilités             | -1,076.2000000000   |            |     |               |       |          |      |               | -1,076.20     |               |                | -0.0024   |
| 4664000     | Reliquat FDG Hon CAC                                              | Disponibilités             | 936.2800000000      |            |     |               |       |          |      |               | 936.28        |               |                | 0.0021    |
| 4881000     | Prov honoraires CAC                                               | Disponibilités             | -2,056.2900000000   |            |     |               |       |          |      |               | -2,056.29     |               |                | -0.0045   |
| 4882000     | Prov frais valorisateur                                           | Disponibilités             | -1,867.0000000000   |            |     |               |       |          |      |               | -1,867.00     |               |                | -0.0041   |
| 4884000     | Prov frais depositaire                                            | Disponibilités             | -3,150.5900000000   |            |     |               |       |          |      |               | -3,150.59     |               |                | -0.0069   |
| 4885010     | Prov frais de gest financ<br>13C                                  | Disponibilités             | -22,357.8000000000  |            |     |               |       |          |      |               | -22,357.80    |               |                | -0.0490   |
| 4885220     | Prov frais de gest financ<br>27C                                  | Disponibilités             | -8,095.1000000000   |            |     |               |       |          |      |               | -8,095.10     |               |                | -0.0178   |
| 4889010     | Frais de fonctionnement<br>13C                                    | Disponibilités             | -2,809.6000000000   |            |     |               |       |          |      |               | -2,809.60     |               |                | -0.0062   |
| 4889220     | Frais de fonctionnement<br>27C                                    | Disponibilités             | -2,034.3200000000   |            |     |               |       |          |      |               | -2,034.32     |               |                | -0.0045   |
| 5110300     | Cash BP2S BNP PARIBAS<br>SA                                       | Disponibilités             | 69,042.7200000000   |            |     |               |       |          |      |               | 69,042.72     |               |                | 0.1514    |
| 5110380     | Cash Newedge NEWEDGE                                              | Disponibilités             | 296,631.9500000000  |            |     |               |       |          |      |               | 296,631.95    |               |                | 0.6505    |
| 5110384     | Cash Newedge                                                      | Disponibilités             | -132,696.7000000000 |            |     |               |       |          |      |               | -132,696.70   |               |                | -0.2910   |

Fonds: LF OBLIGATIONS LT (PFP025) EUR

Date de VL: 28/06/2024

| Code valeur       | Lib. court valeur                   | Libellé type instrument | Quantité             | Dev cot | S/C | PRU (dev cot) | Cours  | Dt cours   | Orig     | PRT (dev réf) | VBT (dev réf) | CCT (dev réf) | PMVT (dev réf) | Actif net |
|-------------------|-------------------------------------|-------------------------|----------------------|---------|-----|---------------|--------|------------|----------|---------------|---------------|---------------|----------------|-----------|
| Total devise :    |                                     |                         |                      | EUR     |     |               |        |            |          |               | 253,309.62    |               |                | 0.5555    |
| 5110300           | Cash BP2S BNP PARIBAS SA            | Disponibilités          | 717.7700000000       | USD     |     |               |        |            |          |               | 669.72        |               |                | 0.0015    |
| Total devise :    |                                     |                         |                      | USD     |     |               |        |            |          |               | 669.72        |               |                | 0.0015    |
| Total instrument: |                                     | Disponibilités          |                      |         |     |               |        |            |          |               | 253,979.34    |               |                | 0.5570    |
| BE0008520810      | BGB 3 3/4 45-STRIP 0% 13-22/06/2033 | Obligations             | 2,000,000.0000000000 | EUR     |     | 71.932000     | 76.34  | 28/06/2024 | ontribut | 1,438,640.00  | 1,526,760.00  | 0.00          | 88,120.00      | 3.3482    |
| DE0001102515      | DEUTSCHLAND REP 0% 20-15/05/2035    | Obligations             | 8,700,000.0000000000 |         |     | 91.615816     | 76.03  | 28/06/2024 | ontribut | 7,970,576.00  | 6,614,784.00  | 0.00          | -1,355,792.00  | 14.5061   |
| DE0001102606      | DEUTSCHLAND REP 1.7% 22-15/08/2032  | Obligations             | 2,000,000.0000000000 |         |     | 94.513699     | 94.71  | 28/06/2024 | ontribut | 1,890,273.97  | 1,924,182.57  | 29,912.57     | 33,908.60      | 4.2197    |
| ES00000127A2      | SPANISH GOVT 1.95% 15-30/07/2030    | Obligations             | 5,000,000.0000000000 |         |     | 113.242086    | 93.90  | 28/06/2024 | ontribut | 5,662,104.32  | 4,784,915.98  | 90,040.98     | -877,188.34    | 10.4932   |
| ES00000128Q6      | SPANISH GOVT 2.35% 17-30/07/2033    | Obligations             | 3,100,000.0000000000 |         |     | 92.087673     | 92.70  | 28/06/2024 | ontribut | 2,854,717.87  | 2,940,821.78  | 67,276.78     | 86,103.91      | 6.4492    |
| FR0011883966      | FRANCE O.A.T. 2.5% 14-25/05/2030    | Obligations             | 9,200,000.0000000000 |         |     | 127.706680    | 97.17  | 28/06/2024 | ontribut | 11,749,014.59 | 8,963,355.21  | 23,945.21     | -2,785,659.38  | 19.6565   |
| FR0012993103      | FRANCE O.A.T. 1.5% 15-25/05/2031    | Obligations             | 2,000,000.0000000000 |         |     | 103.977165    | 90.42  | 28/06/2024 | ontribut | 2,079,543.29  | 1,811,543.29  | 3,123.29      | -268,000.00    | 3.9727    |
| FR001400BKZ3      | FRANCE O.A.T. 2% 22-25/11/2032      | Obligations             | 3,000,000.0000000000 |         |     | 91.893699     | 91.54  | 28/06/2024 | ontribut | 2,756,810.96  | 2,782,325.57  | 36,065.57     | 25,514.61      | 6.1016    |
| IE00BFZRQ242      | IRISH GOVT 1.35% 18-18/03/2031      | Obligations             | 1,000,000.0000000000 |         |     | 90.528301     | 91.28  | 28/06/2024 | ontribut | 905,283.01    | 916,730.55    | 3,920.55      | 11,447.54      | 2.0104    |
| IE00BJ38CR43      | IRISH GOVT 2.4% 14-15/05/2030       | Obligations             | 1,000,000.0000000000 |         |     | 128.158781    | 97.98  | 28/06/2024 | ontribut | 1,281,587.81  | 982,911.16    | 3,156.16      | -298,676.65    | 2.1555    |
| IT0005024234      | ITALY BTPS 3.5% 14-01/03/2030       | Obligations             | 3,000,000.0000000000 |         |     | 128.907239    | 99.65  | 28/06/2024 | ontribut | 3,867,217.17  | 3,024,445.20  | 35,095.20     | -842,771.97    | 6.6326    |
| IT0005422891      | ITALY BTPS 0.9% 20-01/04/2031       | Obligations             | 7,000,000.0000000000 |         |     | 78.998988     | 83.44  | 28/06/2024 | ontribut | 5,529,929.19  | 5,856,356.07  | 15,836.07     | 326,426.88     | 12.8429   |
| PTOTENOE0034      | PORTUGUESE OTS 0.9% 20-12/10/2035   | Obligations             | 250,000.0000000000   |         |     | 73.245656     | 77.70  | 28/06/2024 | ontribut | 183,114.14    | 195,866.70    | 1,622.95      | 12,752.56      | 0.4295    |
| PTOTEROE0014      | PORTUGUESE OTS 3.875% 14-15/02/2030 | Obligations             | 1,800,000.0000000000 |         |     | 129.083477    | 105.21 | 28/06/2024 | ontribut | 2,323,502.59  | 1,920,052.18  | 26,299.18     | -403,450.41    | 4.2106    |
| Total devise :    |                                     |                         |                      | EUR     |     |               |        |            |          | 50,492,314.91 | 44,245,050.26 | 336,294.51    | -6,247,264.65  | 97.0287   |
| Total instrument: |                                     | Obligations             |                      |         |     |               |        |            |          | 50,492,314.91 | 44,245,050.26 | 336,294.51    | -6,247,264.65  | 97.0287   |
| OEU4 - 171        | EURO-BOBL FUTURE 06/09/2024         | Futures                 | 85.0000000000        | EUR     | A   | 115.440024    | 116.44 | 28/06/2024 | ontribut | 9,812,402.00  | 84,998.00     | 0.00          | 84,998.00      | 0.1864    |
| Total devise :    |                                     |                         |                      | EUR     |     |               |        |            |          | 9,812,402.00  | 84,998.00     | 0.00          | 84,998.00      | 0.1864    |
| Total instrument: |                                     | Futures                 |                      |         |     |               |        |            |          | 9,812,402.00  | 84,998.00     | 0.00          | 84,998.00      | 0.1864    |
| CS2PFP025         | Ctie cash donne en garantie         | Garanties               | 132,696.7000000000   | EUR     |     | 1.000000      | 1.00   | 28/06/2024 |          | 132,696.70    | 0.00          |               | 0.00           | 0.0000    |
| Total devise :    |                                     |                         |                      | EUR     |     |               |        |            |          | 132,696.70    | 0.00          |               | 0.00           | 0.0000    |
| Total instrument: |                                     | Garanties               |                      |         |     |               |        |            |          | 132,696.70    | 0.00          |               | 0.00           | 0.0000    |

Fonds: LF OBLIGATIONS LT (PFP025) EUR

Date de VL: 28/06/2024

| Code valeur             | Lib. court valeur              | Libellé type instrument | Quantité     | Dev cot | S/C | PRU (dev cot)  | Cours      | Dt cours   | Orig     | PRT (dev réf) | VBT (dev réf) | CCT (dev réf) | PMVT (dev réf) | Actif net |
|-------------------------|--------------------------------|-------------------------|--------------|---------|-----|----------------|------------|------------|----------|---------------|---------------|---------------|----------------|-----------|
| FR0010609115            | LF TRESORERIE ISR PART I       | OPCVM                   | 9.0000000000 | EUR     |     | 112,283.202222 | 112,881.03 | 27/06/2024 | ontribut | 1,010,548.82  | 1,015,929.27  | 0.00          | 5,380.45       | 2.2279    |
| Total devise :          |                                |                         |              | EUR     |     |                |            |            |          | 1,010,548.82  | 1,015,929.27  | 0.00          | 5,380.45       | 2.2279    |
| Total instrument: OPCVM |                                |                         |              |         |     |                |            |            |          | 1,010,548.82  | 1,015,929.27  | 0.00          | 5,380.45       | 2.2279    |
| FONDS:                  | LF OBLIGATIONS LT (PFP025) EUR |                         |              |         |     |                |            |            |          | 61,447,962.43 | 45,599,956.87 | 336,294.51    | -6,156,886.20  | 100.0000  |