

# LA FRANCAISE PROTECTAUX

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 PROTECTAUX

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 PROTECTAUX 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 PROTECTAUX 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 PROTECTAUX acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

A Paris La Défense, le 7 août 2024

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés



Virginie GAITTE

Fonds: LF PROTECTAUX (PFP009) EUR

Date de VL: 28/06/2024

Classe (VL)	Code ISIN Part	Actif Net Part en Dev. de Réf.	Nb. Parts	Disponibilités	VL (dev part) 6/28/24	VL préc. (dev part) 6/27/24	Var. VL (%)	Statut
I cap	FR0010107953	3,133,057.780000	5,237.4514000000	327,991.53	598.200000	595.86	0.39	VAL
R cap	FR0010996736	3,203,621.600000	5,516.3206800000	327,991.53	580.750000	578.49	0.39	VAL
Terme cap	FR0013289485	114,919.960000	107.6532900000	327,991.53	1,067.500000	1,063.33	0.39	VAL

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
3510000	Appels de marge	Disponibilités	70,560.0000000000	EUR							70,560.00			1.0937
4030000	Rachats a regler	Disponibilités	-4,697.4000000000								-4,697.40			-0.0728
4030590	Prov frais RTO	Disponibilités	-4,400.0000000000								-4,400.00			-0.0682
4161004	Ctie cash donne en garantie	Disponibilités	162,500.2000000000								162,500.20			2.5188
4630100	Frais et commissions a payer	Disponibilités	-958.6100000000								-958.61			-0.0149
4640000	FDG fonct A-1 a payer	Disponibilités	-1,990.1000000000								-1,990.10			-0.0308
4660000	Reliquat FDG fonct	Disponibilités	12,130.0000000000								12,130.00			0.1880
4662000	Reliquat FDG valorisateur	Disponibilités	-5,940.8400000000								-5,940.84			-0.0921
4663000	Reliquat FDG depositaire Controparte Debito da equalizz. 46	Disponibilités	31.5500000000								31.55			0.0005
4664000	Reliquat FDG Hon CAC	Disponibilités	-3,413.1100000000								-3,413.11			-0.0529
4881000	Prov honoraires CAC	Disponibilités	-3,580.2100000000								-3,580.21			-0.0555
4882000	Prov frais valorisateur	Disponibilités	-904.1500000000								-904.15			-0.0140
4884000	Prov frais depositaire	Disponibilités	-1,217.0500000000								-1,217.05			-0.0189
4885010	Prov frais de gest financ 13C	Disponibilités	-974.6000000000								-974.60			-0.0151
4885030	Prov frais de gest financ 44C	Disponibilités	-2,238.1500000000								-2,238.15			-0.0347
4885260	Prov frais de gest financ 30C	Disponibilités	-35.8500000000								-35.85			-0.0006
4889010	Frais de fonctionnement 13C	Disponibilités	-1,950.9300000000								-1,950.93			-0.0302
4889030	Frais de fonctionnement 44C	Disponibilités	-371.5100000000								-371.51			-0.0058
4889260	Frais de fonctionnement 30C	Disponibilités	-14.2600000000								-14.26			-0.0002
5110300	Cash BP2S BNP PARIBAS SA	Disponibilités	-10,498.3700000000								-10,498.37			-0.1627
5110380	Cash Newedge NEWEDGE	Disponibilités	288,455.1200000000								288,455.12			4.4711
5110384	Cash Newedge	Disponibilités	-162,500.2000000000								-162,500.20			-2.5188

Fonds: LF PROTECTAUX (PFP009) 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							327,991.53			5.0839
Total instrument:		Disponibilités									327,991.53			5.0839
FR0010810036	FRTR FUNG STRIP 0% 09-25/10/2024	Obligations	500,000.0000000000	EUR		97.817064	98.87	28/06/2024	ontribut	489,085.32	494,340.00	0.00	5,254.68	7.6623
FR0013415627	FRANCE O.A.T. 0% 19-25/03/2025	Obligations	300,000.0000000000			96.775000	97.50	28/06/2024	ontribut	290,325.00	292,497.00	0.00	2,172.00	4.5337
FR0014007TY9	FRANCE O.A.T. 0% 22-25/02/2025	Obligations	500,000.0000000000			96.916000	97.76	28/06/2024	ontribut	484,580.00	488,810.00	0.00	4,230.00	7.5766
Total devise :				EUR						1,263,990.32	1,275,647.00	0.00	11,656.68	19.7726
Total instrument:		Obligations								1,263,990.32	1,275,647.00	0.00	11,656.68	19.7726
RXU4 - 130	EURO-BUND FUTURE 06/09/2024	Futures	-38.0000000000	EUR	V	130.130000	131.62	28/06/2024	ontribut	-4,944,940.00	-56,620.00	0.00	-56,620.00	-0.8776
RXU4 - 131	EURO-BUND FUTURE 06/09/2024	Futures	-1.0000000000		V	130.350000	131.62	28/06/2024	ontribut	-130,350.00	-1,270.00	0.00	-1,270.00	-0.0197
RXU4 - 132	EURO-BUND FUTURE 06/09/2024	Futures	-1.0000000000		V	130.350000	131.62	28/06/2024	ontribut	-130,350.00	-1,270.00	0.00	-1,270.00	-0.0197
UBU4 - 133	EURO BUXL 30Y BONDS 06/09/2024	Futures	-6.0000000000		V	128.340000	130.24	28/06/2024	ontribut	-770,040.00	-11,400.00	0.00	-11,400.00	-0.1767
Total devise :				EUR						-5,975,680.00	-70,560.00	0.00	-70,560.00	-1.0937
Total instrument:		Futures								-5,975,680.00	-70,560.00	0.00	-70,560.00	-1.0937
CS1PFP009	Ctie cash donne en garantie	Garanties	162,500.2000000000	EUR		1.000000	1.00	28/06/2024		162,500.20	0.00		0.00	0.0000
Total devise :				EUR						162,500.20	0.00		0.00	0.0000
Total instrument:		Garanties								162,500.20	0.00		0.00	0.0000
FR0127921338	FRENCH BTF 0% 23-04/09/2024	TCN	1,500,000.0000000000	EUR		99.229776	99.36	28/06/2024	ontribut	1,488,446.64	1,490,401.37	0.00	1,954.73	23.1013
FR0128379395	FRENCH BTF 0% 24-17/07/2024	TCN	1,500,000.0000000000			99.205617	99.86	28/06/2024	ontribut	1,488,084.25	1,497,843.78	0.00	9,759.53	23.2166
FR0128379403	FRENCH BTF 0% 24-31/07/2024	TCN	500,000.0000000000			99.199878	99.71	28/06/2024	ontribut	495,999.39	498,561.23	0.00	2,561.84	7.7277
FR0128379403	FRENCH BTF 0% 24-31/07/2024	TCN	1,000,000.0000000000			99.199879	99.71	28/06/2024	ontribut	991,998.79	997,122.46	0.00	5,123.67	15.4554
Total devise :				EUR						4,464,529.07	4,483,928.84	0.00	19,399.77	69.5010
Total instrument:		TCN								4,464,529.07	4,483,928.84	0.00	19,399.77	69.5010
FR0010609115	LF TRESORERIE ISR PART I	OPCVM	3.8500000000	EUR		112,648.677922	112,881.03	27/06/2024	ontribut	433,697.41	434,591.97	0.00	894.56	6.7362
Total devise :				EUR						433,697.41	434,591.97	0.00	894.56	6.7362
Total instrument:		OPCVM								433,697.41	434,591.97	0.00	894.56	6.7362
<b>FONDS:</b>	<b>LF PROTECTAUX (PFP009) EUR</b>									<b>349,037.00</b>	<b>6,451,599.34</b>	<b>0.00</b>	<b>-38,608.99</b>	<b>100.0000</b>

Fonds: LF PROTECTAUX (PFP009) EUR