

Tour Exaltis 61, rue Henri Regnault 92075 Paris La Défense Cedex

FCP SYSTEMATIC EQUITY OVERLAY

Attestation du commissaire aux comptes relative à la composition de l'actif au 31 décembre 2024

FCP SYSTEMATIC EQUITY OVERLAY

36, quai Henri IV 75004 Paris

Attestation du commissaire aux comptes relative à la composition de l'actif au 31 décembre 2024

A la société de gestion,

En notre qualité de commissaire aux comptes du FCP SYSTEMATIC EQUITY OVERLAY, et en application des dispositions de 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 31 décembre 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 de l'OPCVM 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 mission. 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 de l'OPCVM acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Le Commissaire aux comptes

Forvis Mazars SA

Paris La Défense, date de la signature électronique Document authentifié et daté par signature électronique

Bertrand DESPORTES

Associé

Batch Report le 08/01/25 15:10:36 PAGE 89 / 131

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 31/12/24

Devise de fixing : FXR Devises Reuters

PORTEFEUILLE : 000TQ0 SYSTEMATI EQ OVERLAY Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR , Tris : BVALO4) VL VALIDEE

V A L E U R	STATUTS DOSSIER	SIER QUANTITE ET DEV P.R.U EN DI		VISE DATE COURS I		<	Devise du portefeuille -		> PRCT			
	VAL/LI GNE	EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR. COU	RS COTA	VALEUR	F	PRIX REVIENT TOTA		COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	ACT NET
III - TITRES D OPC												
	NTS DAUTRES ETATS M NR: EUR EURO	IEMBRE DE L UE										
FR0000009987 Union Plus IC		8.	P EUR	188639.8775	M 31/12/24	202759.78	4	1, 509, 119. 02	1, 622, 078. 24	0.00	112, 959. 22	19.09
FR0007075122 OSTRUM SRI MONEY I	C	121.	P EUR	12332.8083	M 01/01/25	13261.94	5	1, 492, 269. 80	1, 604, 694. 74	0.00	112, 424. 94	
FR0010392951 OSTRUM SRI CASH M		142.50196	P EUR	10240.3024	M 01/01/25	10546.26	5	1, 459, 263. 17	1, 502, 862. 72	0.00	43, 599. 55	
FR0010799007 OSTRUM SRI MONE 6N		146.	P EUR	10219. 9558	M 01/01/25	10983.72	5	1, 492, 113. 55	1, 603, 623. 12	0.00	111, 509. 57	
FR0010831693 OSTRUM SRI CAS PLU		14.0033	P EUR	101198.7567	M 01/01/25	108580.52	5	1, 417, 116. 55	1, 520, 485. 60	0.00	103, 369. 05	17.90
SOUS TOTAL L	DEVISE VALEUR : EUR EU	JRU			CIMIII (EUD)		7, 369, 882. 09	7, 853, 744. 42	0.00	483, 862. 33	02.45
					CUMUL (EUR)			7, 307, 662. 07	7, 655, 744. 42	0.00	403,002.33	72.43
VI - ENGAGEMENTS SUR MA												
ENGAGEMENTS A TER		_										
	ES - MARCHE REGLEMENTI TION : EUR EURO	E										
01NL00001K38 EURO S 250620 P480		120.	P EUR	216, 6105	M 30/12/24	191.9	4	259, 932. 63	230, 280. 00	0.00	-29, 652. 63	2.71
01NL00001MGU EURO S 251219 P450		80.	P EUR	153.8	M 30/12/24	181.9	4	123, 040. 00	145, 520. 00	0.00	22, 480. 00	
	DEVISE COTATION : EUR E		LOIC	100.0	007 12721	101.7		120,010.00	110,020.00	0.00	22, 100.00	1.71
					CUMUL (EUR)		382, 972. 63	375, 800. 00	0.00	-7, 172. 63	4.42
	RES - MARCHE REGLEMEN	TE										
	TON : USD DOLLAR US											
OFUL00000BKN SP 500 250620 P550		15.	P USD	262.4786	M 31/12/24	109.25	4	180, 791. 97	79, 128. 44	0.00	-101, 663. 53	
OFUL00000C00 SP 500 251219 P600	0 DEVISE COTATION : USD D	12.	P USD	302.8125	M 31/12/24	316.	4	169, 736. 00	183, 099. 95	0.00	13, 363. 95	2. 16
SOUS TOTAL L	EVISE COTATION . USD L	DOLLAR US			CUMUL (FIIR)		350, 527. 97	262, 228. 39	0.00	-88, 299. 58	3.09
					JOHIOL (Lony		330, 321. 71	202, 220. 37	0.00	50,277.50	3.07
ENGAGEMENTS A TER	ME CONDITIONNELS											
					CUMUL (EUR)		733, 500. 60	638, 028. 39	0.00	-95, 472. 21	7.51
IX TRESORERIE												
IX - TRESORERIE DETTES ET CREANCES	2											
FRAIS DE GESTION)											
FRAIS DE GESTION FGAMFEUR Prov cotisation AN	1F	-81.97	EUR	1.	31/12/24	1.		-81.97	-81. 97	0.00	0.00	0.00
FGPVFC1EUR Frais de Gest. Fix		-2, 265. 72	EUR	1.	31/12/24	1.		-2, 265. 72	-2, 265. 72	0.00		-0.03
FRAIS DE GESTION		2,200.72	Lon		01, 12, 24			2,200.72	2,233.72	0.00	0.00	0.00
					CUMUL (EUR)		-2, 347. 69	-2, 347. 69	0.00	0.00	-0.03
				` '								

DISPONIBILITES

PAGE 90 / 131 Batch Report le 08/01/25 15:10:36

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 31/12/24

Devise de fixing : FXR Devises Reuters

PORTEFEUILLE : 000TQ0 SYSTEMATI EQ OVERLAY Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR , Tris : BVALO4) VL VALIDEE

V	ALEUR	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVIS ET EXPR. COURS	E DATE COTA	COURS VALEUR	I F	PRIX REVIENT TOTA	Devise du por VALEUR BOURSIERE	tefeuille - COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
BQCI EUR BQCI USD	AVOIRS CACEIS Bank CACEIS Bank AVOIRS		5, 497. 64 -43. 14	EUR USD	1. 0.96244784	31/12/24 31/12/24	1. 0.9657170	4	5, 497. 64 -41. 52	5, 497. 64 -41. 66	0.00 0.00	0. 00 -0. 14	
	AVOIRS					CUMUL (EUR)		5, 456. 12	5, 455. 98	0.00	-0.14	0.06
IX - TRES	SORERIE					CUMUL (EUR)		3, 108. 43	3, 108. 29	0.00	-0.14	0.04
PORTEFEUILLE : SYSTEMATI EQ OVERLAY (000TQO) (EUR) 8, 106, 491. 12 8, 494, 881. 10								0.00	388, 389. 98	3 100.00			

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock: Stock admi principal au 31/12/24

Devise de fixing : FXR Devises Reuters

PORTEFEUILLE : 000TQ0 SYSTEMATI EQ OVERLAY VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame: PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR, Tris: BVALO4)

> Portefeuille titres : 8, 491, 772.81

Frais de gestion du jour

Prov cotisation AMF : 0.22 EUR Frais de Gest. Fixe : 71.95 EUR

Frais de gestion charge Entreprise

Frais maximum notice : 116.05 EUR

Part Actif net Valeur liquidative Coeffi ci ent Coeff resultat Change Prix std Souscript. Prix std Rachat Devi se Nombre de parts 5,943.61 5,607.18

C1 FR0013439981 SYSTEMATI EQTY OVE C EUR 8, 494, 881. 10 1,515. 5,607.18 100.

> Actif net total en EUR : 8, 494, 881. 10

Precedente VL en date du 30/12/24 :

SYSTEMATI EQTY OVE C 5, 602. 19 (EUR) Variation : +0.089% Prec. VL: