

## **SUNNY ALPHA CLUB**

**Document d'information périodique au 28/06/2024**

## Sommaire

|                                                                                             |    |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|----|
| ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR                                                                   | 3  |
| NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART OU ACTION              | 4  |
| ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR                                                      | 5  |
| MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR                           | 6  |
| DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE                                                            | 7  |
| RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR DEVISE                                          | 8  |
| RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR SECTEUR ÉCONOMIQUE                              | 9  |
| RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR              | 10 |
| VENTILATION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE                      | 11 |
| COMMISSION DE PERFORMANCE                                                                   | 12 |
| INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)                                       | 13 |
| OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE                                                                | 17 |
| INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS                                                    | 18 |
| INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS                                            | 19 |
| INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE                                                  | 20 |
| INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT                                       | 21 |
| INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS                                         | 22 |
| OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)              | 23 |
| INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART) | 24 |
| SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE                                                                    | 25 |

## SUNNY ALPHA CLUB

---

### ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR

| Eléments de l'état du patrimoine                                                                           | Montant à l'arrêté<br>périodique |
|------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------------------------------|
| a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier | 64.690.424,24                    |
| b) Avoirs bancaires                                                                                        | 4.481.489,71                     |
| c) Autres actifs détenus par l'OPCVM                                                                       | 7.626.658,51                     |
| d) Total des actifs détenus par l'OPCVM                                                                    | 76.798.572,46                    |
| e) Passif                                                                                                  | -1.184.494,21                    |
| f) Valeur nette d'inventaire                                                                               | 75.614.078,25                    |

## SUNNY ALPHA CLUB

---

### NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART OU ACTION

| Code ISIN de la part | Libellé de la part | Affectation des sommes distribuables | Devise de la part | Actif net de la part | Nombre de parts | Valeur liquidative |
|----------------------|--------------------|--------------------------------------|-------------------|----------------------|-----------------|--------------------|
| FR0013220613         | PART CAPI I        | Capitalisable                        | EUR               | 14.391.187,65        | 94,7031         | 151.961,10         |
| FR0013317658         | PART CAPI N        | Capitalisable                        | EUR               | 37.672.809,44        | 254.610,9460    | 147,96             |
| FR0013220605         | PART CAPI R        | Capitalisable                        | EUR               | 23.550.081,16        | 167.654,6544    | 140,46             |

## SUNNY ALPHA CLUB

### ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR

| Eléments du portefeuille titres :                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | Pourcentage |                  |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------|------------------|
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | Actif net   | Total des actifs |
| a) Titres financiers éligibles et 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 85,52       | 84,20            |
| b) Titres financiers éligibles et 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                                                                                                                                                                                                                        | 0,00        | 0,00             |
| c) Titres financiers éligibles et 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 | 0,00        | 0,00             |
| d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 0,00        | 0,00             |
| e) Autres actifs                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 8,18        | 8,05             |

## SUNNY ALPHA CLUB

### MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

| Eléments du portefeuille titres :                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   | Mouvements (en montant) |               |
|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|-------------------------|---------------|
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                     | Acquisitions            | Cessions      |
| a) Titres financiers éligibles et 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 75.795.963,36           | 22.292.527,38 |
| b) Titres financiers éligibles et 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                                                                                                                                                                                                                        | 0,00                    | 0,00          |
| c) Titres financiers éligibles et 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 | 0,00                    | 0,00          |
| d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  | 0,00                    | 0,00          |
| e) Autres actifs                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    | 6.435.020,04            | 1.280.205,89  |

| Mouvements intervenus au cours de la période | Mouvements (en montant) |
|----------------------------------------------|-------------------------|
| Acquisitions                                 | 82.305.408,40           |
| Cessions                                     | 23.689.333,27           |

### DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Pas de distribution sur la période.

## SUNNY ALPHA CLUB

---

### RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR DEVISE

| Devise           | En montant (EUR)     | Pourcentage  |                  |
|------------------|----------------------|--------------|------------------|
|                  |                      | Actif net    | Total des actifs |
| Euro             | 54.388.236,32        | 71,93        | 70,82            |
| Dollar américain | 9.686.811,69         | 12,81        | 12,61            |
| Pound sterling   | 592.637,13           | 0,78         | 0,77             |
| <b>Total</b>     | <b>64.667.685,14</b> | <b>85,52</b> | <b>84,20</b>     |



## SUNNY ALPHA CLUB

### RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR SECTEUR ÉCONOMIQUE

| Secteur économique                         | Pourcentage  |                  |
|--------------------------------------------|--------------|------------------|
|                                            | Actif net    | Total des actifs |
| Souverains                                 | 27,28        | 26,86            |
| Banques                                    | 8,06         | 7,94             |
| Téléphonie fixe                            | 7,51         | 7,40             |
| Assurances multirisques                    | 4,76         | 4,69             |
| Voyage et Loisirs                          | 3,68         | 3,62             |
| Automobiles et équipementiers              | 2,81         | 2,77             |
|                                            | 2,66         | 2,62             |
| Matériels et équipements informatiques     | 2,55         | 2,51             |
| Commerce de détail                         | 2,39         | 2,35             |
| Transport industriel                       | 2,29         | 2,26             |
| Construction / Matériaux                   | 2,04         | 2,01             |
| Inv immobilier et serv                     | 1,77         | 1,74             |
| Finance générale                           | 1,73         | 1,71             |
| Services de soutien aux entreprises        | 1,72         | 1,69             |
| Boissons                                   | 1,45         | 1,43             |
| Chimie                                     | 1,12         | 1,10             |
| Industrie pharmaceutique et Biotechnologie | 1,12         | 1,10             |
| Média                                      | 1,05         | 1,03             |
| Articles de Loisirs                        | 1,05         | 1,03             |
| Industries généralistes                    | 0,92         | 0,91             |
| Electricité                                | 0,91         | 0,89             |
| Métaux industriels                         | 0,88         | 0,87             |
| Electronique / Equipements électriques     | 0,84         | 0,83             |
| Produits à usage domestique                | 0,76         | 0,74             |
| SOC PLACEMENT IMMOBILIER                   | 0,73         | 0,72             |
| Services bancaires invest et de courtage   | 0,69         | 0,68             |
| Alimentation                               | 0,53         | 0,52             |
| Gaz eau et autres serv aux collectivités   | 0,52         | 0,51             |
| Aérospatial / Défense                      | 0,42         | 0,42             |
| Compagnies pétrolières                     | 0,41         | 0,40             |
| Equipements et services de santé           | 0,39         | 0,38             |
| Assurances                                 | 0,36         | 0,35             |
| Equip serv/distrib prod pétro              | 0,11         | 0,11             |
| Logiciel / Services informatiques          | 0,01         | 0,01             |
| <b>Total</b>                               | <b>85,52</b> | <b>84,20</b>     |

## SUNNY ALPHA CLUB

### RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR

| Pays         | Pourcentage  |                  |
|--------------|--------------|------------------|
|              | Actif net    | Total des actifs |
| France       | 31,26        | 30,78            |
| États-Unis   | 12,97        | 12,76            |
| Allemagne    | 9,38         | 9,23             |
| Italie       | 9,10         | 8,96             |
| Espagne      | 7,37         | 7,25             |
| Pays-Bas     | 4,13         | 4,07             |
|              | 2,66         | 2,62             |
| Royaume-Uni  | 2,38         | 2,35             |
| Belgique     | 1,54         | 1,51             |
| Autriche     | 1,16         | 1,15             |
| Suisse       | 0,91         | 0,90             |
| Finlande     | 0,76         | 0,75             |
| Suède        | 0,71         | 0,70             |
| Mexique      | 0,66         | 0,65             |
| Portugal     | 0,42         | 0,42             |
| Corée        | 0,11         | 0,10             |
| <b>Total</b> | <b>85,52</b> | <b>84,20</b>     |

## SUNNY ALPHA CLUB

### VENTILATION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE

| Nature d'actifs                                                   | Pourcentage |                  |
|-------------------------------------------------------------------|-------------|------------------|
|                                                                   | Actif net   | Total des actifs |
| <b>Parts d'OPC</b>                                                | <b>8,15</b> | <b>8,02</b>      |
| OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne | 8,15        | 8,02             |
| FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne   | 0,00        | 0,00             |
| Autres OPC et fonds d'investissements                             | 0,00        | 0,00             |
| <b>Autres actifs</b>                                              | <b>0,03</b> | <b>0,03</b>      |
| <b>Total</b>                                                      | <b>8,18</b> | <b>8,05</b>      |

## SUNNY ALPHA CLUB

---

### COMMISSION DE PERFORMANCE

| PART CAPI I                                 | 28/06/2024 |
|---------------------------------------------|------------|
| Commission de performance (frais variables) | 0,00       |
| Pourcentage de commission de performance    | 0,00       |

| PART CAPI N                                 | 28/06/2024 |
|---------------------------------------------|------------|
| Commission de performance (frais variables) | 0,00       |
| Pourcentage de commission de performance    | 0,00       |

| PART CAPI R                                 | 28/06/2024 |
|---------------------------------------------|------------|
| Commission de performance (frais variables) | 0,00       |
| Pourcentage de commission de performance    | 0,00       |

# SUNNY ALPHA CLUB

## INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

| Instruments                                                                         | Devise | Quantité | Montant              | %AN          |
|-------------------------------------------------------------------------------------|--------|----------|----------------------|--------------|
| <b>Actions et valeurs assimilées</b>                                                |        |          | <b>11.649.332,22</b> | <b>15,41</b> |
| <b>Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b> |        |          | <b>11.649.332,22</b> | <b>15,41</b> |
| Aérospatial / Défense                                                               |        |          | 320.650,00           | 0,42         |
| AIRBUS                                                                              | EUR    | 2.500    | 320.650,00           | 0,42         |
| Alimentation                                                                        |        |          | 399.560,00           | 0,53         |
| DANONE                                                                              | EUR    | 7.000    | 399.560,00           | 0,53         |
| Assurances multirisques                                                             |        |          | 382.125,00           | 0,51         |
| AXA                                                                                 | EUR    | 12.500   | 382.125,00           | 0,51         |
| Automobiles et équipementiers                                                       |        |          | 732.282,18           | 0,97         |
| FORVIA                                                                              | EUR    | 25.450   | 281.349,75           | 0,37         |
| IVECO GROUP                                                                         | EUR    | 43.069   | 450.932,43           | 0,60         |
| Banques                                                                             |        |          | 970.220,60           | 1,28         |
| BNP PARIBAS ACTIONS A                                                               | EUR    | 5.500    | 327.415,00           | 0,43         |
| CAIXABANK                                                                           | EUR    | 40.000   | 197.720,00           | 0,26         |
| SOCIETE GENERALE                                                                    | EUR    | 20.305   | 445.085,60           | 0,59         |
| Chimie                                                                              |        |          | 319.334,40           | 0,42         |
| AIR LIQUIDE                                                                         | EUR    | 1.980    | 319.334,40           | 0,42         |
| Construction / Matériaux                                                            |        |          | 377.624,00           | 0,50         |
| SAINT-GOBAIN                                                                        | EUR    | 5.200    | 377.624,00           | 0,50         |
| Electricité                                                                         |        |          | 380.030,00           | 0,50         |
| ENDESA                                                                              | EUR    | 12.000   | 210.420,00           | 0,28         |
| IBERDROLA                                                                           | EUR    | 14.000   | 169.610,00           | 0,22         |
| Electronique / Equipements électriques                                              |        |          | 539.357,80           | 0,71         |
| ALSTOM REGROUPT                                                                     | EUR    | 34.354   | 539.357,80           | 0,71         |
| Equip serv/distrib prod pétro                                                       |        |          | 82.568,83            | 0,11         |
| CGG RGPT                                                                            | EUR    | 173.064  | 82.568,83            | 0,11         |
| Gaz eau et autres serv aux collectivités                                            |        |          | 390.880,00           | 0,52         |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT                                                                | EUR    | 14.000   | 390.880,00           | 0,52         |
| Industrie pharmaceutique et Biotechnologie                                          |        |          | 845.436,00           | 1,12         |
| SANOFI                                                                              | EUR    | 9.400    | 845.436,00           | 1,12         |
| Logiciel / Services informatiques                                                   |        |          | 9.662,80             | 0,01         |
| ATOS                                                                                | EUR    | 9.800    | 9.662,80             | 0,01         |
| Matériels et équipements informatiques                                              |        |          | 1.527.348,75         | 2,02         |
| INFINEON TECHNOLOGIES                                                               | EUR    | 7.700    | 264.148,50           | 0,35         |
| NOKIA                                                                               | EUR    | 161.300  | 573.824,75           | 0,76         |
| STMICROELECTRONICS                                                                  | EUR    | 18.700   | 689.375,50           | 0,91         |
| Média                                                                               |        |          | 692.676,00           | 0,92         |
| VIVENDI                                                                             | EUR    | 71.000   | 692.676,00           | 0,92         |
| Produits à usage domestique                                                         |        |          | 570.880,00           | 0,76         |
| LVMH MOET HENNESSY VUITTON                                                          | EUR    | 800      | 570.880,00           | 0,76         |
| Services de soutien aux entreprises                                                 |        |          | 569.329,62           | 0,75         |
| ELIS                                                                                | EUR    | 17.271   | 349.219,62           | 0,46         |
| WORLDLINE                                                                           | EUR    | 21.750   | 220.110,00           | 0,29         |

# SUNNY ALPHA CLUB

## INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

| Instruments                                                                                    | Devise | Quantité  | Montant              | %AN          |
|------------------------------------------------------------------------------------------------|--------|-----------|----------------------|--------------|
| Téléphonie fixe                                                                                |        |           | 983.001,00           | 1,30         |
| CELLNEX TELECOM                                                                                | EUR    | 12.000    | 364.440,00           | 0,48         |
| ORANGE                                                                                         | EUR    | 36.500    | 341.421,00           | 0,45         |
| TELECOM ITALIA                                                                                 | EUR    | 1.240.000 | 277.140,00           | 0,37         |
| Voyage et Loisirs                                                                              |        |           | 1.556.365,24         | 2,06         |
| ACCOR                                                                                          | EUR    | 11.950    | 457.685,00           | 0,60         |
| AIR FRANCE-KLM RGPT 2023                                                                       | EUR    | 33.755    | 277.736,14           | 0,37         |
| MELIA HOTELS INTERNATIONAL                                                                     | EUR    | 11.000    | 84.315,00            | 0,11         |
| PIERRE ET VAC.BSA CREANCIERS                                                                   | EUR    | 75.797    | 22.739,10            | 0,03         |
| PIERRE ET VACANCES                                                                             | EUR    | 305.000   | 383.690,00           | 0,51         |
| TUI                                                                                            | EUR    | 50.000    | 330.200,00           | 0,44         |
| <b>Obligations</b>                                                                             |        |           | <b>46.679.944,14</b> | <b>61,73</b> |
| <b>Obligations convertibles en actions négociées sur un marché réglementé</b>                  |        |           | <b>8.962.741,76</b>  | <b>11,85</b> |
| Articles de Loisirs                                                                            |        |           | 793.044,00           | 1,05         |
| UBISOFT 0%19-240924 OCEANE                                                                     | EUR    | 7.000     | 793.044,00           | 1,05         |
| Boissons                                                                                       |        |           | 500.366,02           | 0,66         |
| FOMENTO ECONO 2,625%23-26                                                                      | EUR    | 5         | 500.366,02           | 0,66         |
| Commerce de détail                                                                             |        |           | 382.040,12           | 0,51         |
| FNAC DARTY OC 0,25%23032027                                                                    | EUR    | 5.333     | 382.040,12           | 0,51         |
| Equipements et services de santé                                                               |        |           | 291.635,61           | 0,39         |
| CLARFP 1 7/8 PERP                                                                              | EUR    | 8.295     | 291.635,61           | 0,39         |
| Finance générale                                                                               |        |           | 698.233,22           | 0,92         |
| WENDEL 2,625% 270326                                                                           | EUR    | 7         | 698.233,22           | 0,92         |
| Inv immobilier et serv                                                                         |        |           | 606.142,00           | 0,80         |
| LEG IMMOBILIEEN AG 0,4% 300628                                                                 | EUR    | 7         | 606.142,00           | 0,80         |
| Métaux industriels                                                                             |        |           | 667.382,72           | 0,88         |
| VOESTALPINE 2,75%23-280428 CV                                                                  | EUR    | 7         | 667.382,72           | 0,88         |
| Services bancaires invest et de courtage                                                       |        |           | 522.325,16           | 0,69         |
| SIMONGLBDEV 3,5%23-141126 EXCH                                                                 | EUR    | 5         | 522.325,16           | 0,69         |
| Services de soutien aux entreprises                                                            |        |           | 728.649,00           | 0,96         |
| WORLDLINE 0%19-300726 OCEANE                                                                   | EUR    | 3.000     | 277.881,00           | 0,37         |
| WORLDLINE 0%20-300725 OCEANE                                                                   | EUR    | 4.000     | 450.768,00           | 0,59         |
| Téléphonie fixe                                                                                |        |           | 2.040.575,19         | 2,70         |
| CELLNEX TELECOM 2,125%23-30 CV                                                                 | EUR    | 20        | 2.040.575,19         | 2,70         |
| Transport industriel                                                                           |        |           | 1.732.348,72         | 2,29         |
| DHLGR 0.05 06/30/25                                                                            | EUR    | 18        | 1.732.348,72         | 2,29         |
| <b>Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b> |        |           | <b>37.717.202,38</b> | <b>49,88</b> |
| Assurances                                                                                     |        |           | 271.895,51           | 0,36         |
| MACIF 0,625%21-210627                                                                          | EUR    | 3         | 271.895,51           | 0,36         |
| Assurances multirisques                                                                        |        |           | 3.219.409,14         | 4,26         |
| ASR NEDERLAND TV14-PERP.SUB.                                                                   | EUR    | 500       | 519.077,46           | 0,69         |
| AXA TV05-PERP. EMTN                                                                            | EUR    | 312       | 294.297,99           | 0,39         |
| BNP CARDIF 1%17-291124                                                                         | EUR    | 12        | 1.191.313,97         | 1,58         |
| ETHIAS 5%15-140126 SUBORD.                                                                     | EUR    | 6         | 621.110,43           | 0,82         |

# SUNNY ALPHA CLUB

## INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

| Instruments                            | Devise | Quantité | Montant      | %AN  |
|----------------------------------------|--------|----------|--------------|------|
| MUNRE 4 1/4 05/26/44                   | EUR    | 6        | 593.609,29   | 0,78 |
| Automobiles et équipementiers          |        |          | 1.392.714,71 | 1,84 |
| FORD MOTOR CRED 2,386%19-0226          | EUR    | 200      | 197.049,20   | 0,26 |
| FORVIA 3,125%19-150626                 | EUR    | 200      | 195.865,14   | 0,26 |
| FORVIA 5,125%24-150629                 | EUR    | 300      | 301.371,04   | 0,40 |
| RENAULT 2.5%21-020627                  | EUR    | 1        | 95.676,48    | 0,12 |
| RENAULT 2%18-280926 EMTN               | EUR    | 2        | 194.016,25   | 0,26 |
| STELLANTIS 3,875%20-0126               | EUR    | 400      | 408.736,60   | 0,54 |
| Banques                                |        |          | 5.127.622,30 | 6,78 |
| BCP TV17-071227                        | EUR    | 2        | 220.848,98   | 0,29 |
| BFCM 1%22-230525                       | EUR    | 7        | 684.660,12   | 0,91 |
| BNP PARIBAS 2,75%15-270126             | EUR    | 1.000    | 994.256,45   | 1,31 |
| CARREFOUR BQUE 0,107%21-140625         | EUR    | 7        | 675.634,94   | 0,89 |
| CRELAN TV23-280230                     | EUR    | 5        | 542.190,90   | 0,72 |
| INTESA SANPAOLO TV23-170325            | EUR    | 1.300    | 1.305.670,71 | 1,73 |
| RCI BANQUE 3,75%10042027               | EUR    | 700      | 704.360,20   | 0,93 |
| Boissons                               |        |          | 599.415,60   | 0,79 |
| PIC SUR 6 3/8 07/01/29                 | EUR    | 600      | 599.415,60   | 0,79 |
| Chimie                                 |        |          | 527.820,16   | 0,70 |
| INEOS FINANCE 6,375%24-150429          | EUR    | 500      | 527.820,16   | 0,70 |
| Commerce de détail                     |        |          | 1.421.734,56 | 1,88 |
| ALD 1,25%22-020326                     | EUR    | 7        | 675.666,66   | 0,90 |
| FNAC DARTY 6%24-010429                 | EUR    | 200      | 206.695,54   | 0,27 |
| VERISURE HOLD 9,25%22 151027           | EUR    | 500      | 539.372,36   | 0,71 |
| Compagnies pétrolières                 |        |          | 310.456,02   | 0,41 |
| GALP ENERGIA 2%20-150126               | EUR    | 1        | 98.096,50    | 0,13 |
| OMV TV15-PERP.                         | EUR    | 200      | 212.359,52   | 0,28 |
| Construction / Matériaux               |        |          | 1.162.816,11 | 1,54 |
| ASF 1,125%17-200426 EMTN               | EUR    | 6        | 577.752,00   | 0,77 |
| SPIE 2.625%19-180626                   | EUR    | 6        | 585.064,11   | 0,77 |
| Electricité                            |        |          | 306.750,89   | 0,41 |
| EDF TV13-PERPETUEL EMTN                | EUR    | 3        | 306.750,89   | 0,41 |
| Electronique / Equipements électriques |        |          | 99.529,53    | 0,13 |
| LRFP 3 1/2 06/26/34                    | EUR    | 1        | 99.529,53    | 0,13 |
| Finance générale                       |        |          | 611.457,72   | 0,81 |
| BANIJAY GROUP 6,5% 01032026            | EUR    | 100      | 102.432,72   | 0,14 |
| MOBLUX 7 05/15/30                      | EUR    | 500      | 509.025,00   | 0,67 |
| Industries généralistes                |        |          | 698.685,82   | 0,92 |
| ORANO 3,375%19-230426                  | EUR    | 7        | 698.685,82   | 0,92 |
| Inv immobilier et serv                 |        |          | 729.088,50   | 0,96 |
| GOLDSTORY 6,75%24-010230               | EUR    | 700      | 729.088,50   | 0,96 |
| Matériels et équipements informatiques |        |          | 398.368,52   | 0,53 |
| QUADIENT 2,25%20-030225                | EUR    | 4        | 398.368,52   | 0,53 |
| Média                                  |        |          | 100.540,73   | 0,13 |
| IPSOS 2,875%18-210925                  | EUR    | 1        | 100.540,73   | 0,13 |

# SUNNY ALPHA CLUB

## INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

| Instruments                                                              | Devise | Quantité    | Montant              | %AN          |
|--------------------------------------------------------------------------|--------|-------------|----------------------|--------------|
| SOC PLACEMENT IMMOBILIER                                                 |        |             | 552.623,93           | 0,73         |
| URW TV23-PERP.                                                           | EUR    | 5           | 552.623,93           | 0,73         |
| Souverains                                                               |        |             | 16.282.850,11        | 21,53        |
| ALLEMAGNE 0,5%16-150226                                                  | EUR    | 60.000.000  | 578.913,15           | 0,77         |
| ALLEMAGNE 4,75%03-34                                                     | EUR    | 240.000.000 | 2.983.897,05         | 3,95         |
| AMERIQUE 2%15-150225 T-N                                                 | USD    | 13.000      | 1.198.188,27         | 1,58         |
| ITALY 3,6%23-290925                                                      | EUR    | 4.800       | 4.849.360,80         | 6,41         |
| KOREA 3,875%18-200948                                                    | USD    | 100         | 80.550,04            | 0,11         |
| SPAIN 1,3%16-311026                                                      | EUR    | 2.000       | 1.939.144,37         | 2,56         |
| TII 1 3/4 01/15/34                                                       | USD    | 50.000      | 4.652.796,43         | 6,15         |
| Téléphonie fixe                                                          |        |             | 2.657.592,98         | 3,52         |
| ILIAD 2,375%20-170626                                                    | EUR    | 8           | 773.932,82           | 1,02         |
| ILIAD 5,375%23-150229                                                    | EUR    | 2           | 209.423,31           | 0,28         |
| KPN 5,625%09-300924 MTN                                                  | EUR    | 1.600       | 1.674.236,85         | 2,22         |
| Téléphonie mobile                                                        |        |             | 0,00                 | 0,00         |
| CELLNEX FINANCE 2,25%22-120426                                           | EUR    | 0,00        | 0,00                 | 0,00         |
| Voyage et Loisirs                                                        |        |             | 1.245.829,54         | 1,65         |
| EASYJET 0,875%19-110625                                                  | EUR    | 700         | 681.571,40           | 0,90         |
| EDREAMS ODIGEO 5,5%040727                                                | EUR    | 550         | 564.258,14           | 0,75         |
| <b>Titres de créances</b>                                                |        |             | <b>6.361.147,88</b>  | <b>8,41</b>  |
| <b>Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>  |        |             | <b>6.361.147,88</b>  | <b>8,41</b>  |
| Souverains                                                               |        |             | 4.347.914,08         | 5,75         |
| T 4 1/2 03/31/26                                                         | USD    | 40.000      | 3.755.276,95         | 4,97         |
| UKT 2 3/4 09/07/24                                                       | GBP    | 50.000.000  | 592.637,13           | 0,78         |
| Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé         |        |             | 2.013.233,80         | 2,66         |
| BTPS 3.2 01/28/26                                                        | EUR    | 2.000       | 2.013.233,80         | 2,66         |
| <b>Parts d'OPC et fonds d'investissements</b>                            |        |             | <b>6.162.388,24</b>  | <b>8,15</b>  |
| <b>OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne</b> |        |             | <b>6.162.388,24</b>  | <b>8,15</b>  |
| OPCVM                                                                    |        |             | 6.162.388,24         | 8,15         |
| SUNNY MULTICAPS I FCP 4DEC                                               | EUR    | 16          | 2.407.018,24         | 3,18         |
| SUNNY MULTI-OBLIG R FCP 4DEC                                             | EUR    | 16.800      | 1.833.216,00         | 2,43         |
| SUNNY RECOVERY I FCP 4DEC                                                | EUR    | 14.820      | 1.922.154,00         | 2,54         |
| <b>Total</b>                                                             |        |             | <b>70.852.812,48</b> | <b>93,70</b> |



## SUNNY ALPHA CLUB

### OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE

| Libellé instrument | Valeur actuelle présentée au bilan |             | Montant de l'exposition (*) |             |                      |             |
|--------------------|------------------------------------|-------------|-----------------------------|-------------|----------------------|-------------|
|                    | Actif                              | Passif      | Devises à recevoir (+)      |             | Devises à livrer (-) |             |
|                    |                                    |             | Devise                      | Montant (*) | Devise               | Montant (*) |
| <b>Total</b>       | <b>0,00</b>                        | <b>0,00</b> |                             | <b>0,00</b> |                      | <b>0,00</b> |

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

## SUNNY ALPHA CLUB

### INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS

| Instruments financiers à terme – actions |                  |                                    |        |                             |
|------------------------------------------|------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
| Libellé instrument                       | Quantité/Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|                                          |                  | Actif                              | Passif | +/-                         |
| Futures                                  |                  |                                    |        |                             |
| Sous total                               |                  | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| Options                                  |                  |                                    |        |                             |
| Sous total                               |                  | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| Swaps                                    |                  |                                    |        |                             |
| Sous total                               |                  | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| Autres instruments                       |                  |                                    |        |                             |
| Sous total                               |                  | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| Total                                    |                  | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |

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

## SUNNY ALPHA CLUB

### INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS

| Instruments financiers à terme – taux d'intérêts |                  |                                    |        |                             |
|--------------------------------------------------|------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
| Libellé instrument                               | Quantité/Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|                                                  |                  | Actif                              | Passif | +/-                         |
| Futures                                          |                  |                                    |        |                             |
| LONG GILT 0924                                   | 45,00            | 45.113,05                          | 0,00   | 6.076.196,82                |
| Sous total                                       |                  | 45.113,05                          | 0,00   | 6.076.196,82                |
| Options                                          |                  |                                    |        |                             |
| Sous total                                       |                  | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| Swaps                                            |                  |                                    |        |                             |
| Sous total                                       |                  | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| Autres instruments                               |                  |                                    |        |                             |
| Sous total                                       |                  | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| Total                                            |                  | 45.113,05                          | 0,00   | 6.076.196,82                |

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

## SUNNY ALPHA CLUB

### INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE

| Instruments financiers à terme – de change |                  |                                    |             |                             |
|--------------------------------------------|------------------|------------------------------------|-------------|-----------------------------|
| Libellé instrument                         | Quantité/Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |             | Montant de l'exposition (*) |
|                                            |                  | Actif                              | Passif      | +/-                         |
| Futures                                    |                  |                                    |             |                             |
| EURUSD-CME 0924                            | 31,00            | 0,00                               | -31.944,96  | 0,00                        |
| JPY/USD-CME 0924                           | 55,00            | 0,00                               | -69.210,39  | 0,00                        |
| Sous total                                 |                  | 0,00                               | -101.155,35 | 0,00                        |
| Options                                    |                  |                                    |             |                             |
| Sous total                                 |                  | 0,00                               | 0,00        | 0,00                        |
| Swaps                                      |                  |                                    |             |                             |
| Sous total                                 |                  | 0,00                               | 0,00        | 0,00                        |
| Autres instruments                         |                  |                                    |             |                             |
| Sous total                                 |                  | 0,00                               | 0,00        | 0,00                        |
| Total                                      |                  | 0,00                               | -101.155,35 | 0,00                        |

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

## SUNNY ALPHA CLUB

### INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT

| Instruments financiers à terme – sur risque de crédit |                  |                                    |        |                             |
|-------------------------------------------------------|------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
| Libellé instrument                                    | Quantité/Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|                                                       |                  | Actif                              | Passif | +/-                         |
| Futures                                               |                  |                                    |        |                             |
| Sous total                                            |                  | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| Options                                               |                  |                                    |        |                             |
| Sous total                                            |                  | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| Swaps                                                 |                  |                                    |        |                             |
| Sous total                                            |                  | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| Autres instruments                                    |                  |                                    |        |                             |
| Sous total                                            |                  | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| Total                                                 |                  | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |

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

## SUNNY ALPHA CLUB

### INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS

| Instruments financiers à terme – autres expositions |                  |                                    |         |                             |
|-----------------------------------------------------|------------------|------------------------------------|---------|-----------------------------|
| Libellé instrument                                  | Quantité/Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |         | Montant de l'exposition (*) |
|                                                     |                  | Actif                              | Passif  | +/-                         |
| Futures                                             |                  |                                    |         |                             |
| Mini MSCIEM 0924                                    | 70,00            | 15.031,28                          | 0,00    | 3.180.193,26                |
| SCHATZ-EUX 0924                                     | 80,00            | 16.800,00                          | 0,00    | 8.009.760,00                |
| TNote 2Y-CB 0924                                    | 35,00            | 0,00                               | -255,29 | 6.544.239,86                |
| Sous total                                          |                  | 31.831,28                          | -255,29 | 17.734.193,12               |
| Options                                             |                  |                                    |         |                             |
| PXA/0724/PUT /7,300.                                | 100,00           | 106.420,00                         | 0,00    | -2.348.531,60               |
| Sous total                                          |                  | 106.420,00                         | 0,00    | -2.348.531,60               |
| Swaps                                               |                  |                                    |         |                             |
| Sous total                                          |                  | 0,00                               | 0,00    | 0,00                        |
| Autres instruments                                  |                  |                                    |         |                             |
| Sous total                                          |                  | 0,00                               | 0,00    | 0,00                        |
| Total                                               |                  | 138.251,28                         | -255,29 | 15.385.661,52               |

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

## SUNNY ALPHA CLUB

### OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)

| Libellé instrument | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |             |                      |             | Classe de part couverte |
|--------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|-------------|----------------------|-------------|-------------------------|
|                    | Actif                              | Passif | Devises à recevoir (+)      |             | Devises à livrer (-) |             |                         |
|                    |                                    |        | Devise                      | Montant (*) | Devise               | Montant (*) |                         |
| Total              | 0,00                               | 0,00   |                             | 0,00        |                      | 0,00        |                         |

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

## SUNNY ALPHA CLUB

### INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)

| Libellé instrument | Quantité/ Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) | Classe de part couverte |
|--------------------|-------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|-------------------------|
|                    |                   | Actif                              | Passif | +/-                         |                         |
| Futures            |                   |                                    |        |                             |                         |
| Sous total         |                   | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |                         |
| Options            |                   |                                    |        |                             |                         |
| Sous total         |                   | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |                         |
| Swaps              |                   |                                    |        |                             |                         |
| Sous total         |                   | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |                         |
| Autres instruments |                   |                                    |        |                             |                         |
| Sous total         |                   | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |                         |
| Total              |                   | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |                         |

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



## SUNNY ALPHA CLUB

### SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

|                                                                                             | Valeur actuelle présentée au bilan |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)</b>                          | 70.852.812,48                      |
| <b>Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :</b>               |                                    |
| Total opérations à terme de devises                                                         | 0,00                               |
| Total instruments financiers à terme - actions                                              | 0,00                               |
| Total instruments financiers à terme - taux                                                 | 45.113,05                          |
| Total instruments financiers à terme - change                                               | -101.155,35                        |
| Total instruments financiers à terme - crédit                                               | 0,00                               |
| Total instruments financiers à terme - autres expositions                                   | 137.995,99                         |
| <b>Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises</b> | 0,00                               |
| <b>Autres actifs (+)</b>                                                                    | 5.762.395,65                       |
| <b>Autres passifs (-)</b>                                                                   | -1.083.083,57                      |
| <b>Passifs de financement (-)</b>                                                           | -                                  |
| <b>Total = actif net</b>                                                                    | <b>75.614.078,25</b>               |