

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 29/05/26

Devise de fixing : FXR Devises Reuters

PORTEFEUILLE : 050812 AMUNDI VOLATILITY RISK PREMIA

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P. R. U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<-----> PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	>-----> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
-------------	------------------------------	-------------------------------	------------	-------------------------------------	--------------	-----------------	--------	------------------------------	--	-------------------	------------------------------	-----------------

I - OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES

AUTRES OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE

OBLIGATIONS A TAUX FIXE NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE

DEVISE VALEUR : EUR EURO

XS2908177145	NATU FI 3.25 10-30	PPLIV 10C127247667	600,000.	M EUR	100.97	%	99.50562822	A	605,820.00	605,820.00	0.00	0.00	3.21
--------------	--------------------	--------------------	----------	-------	--------	---	-------------	---	------------	------------	------	------	------

DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

XS1716945743	TELS GR 3.25 11-27	PPLIV 10C127146033	500,000.	M USD	99.96	%	98.3494476	A	424,584.80	428,295.99	0.00	3,711.19	2.27
--------------	--------------------	--------------------	----------	-------	-------	---	------------	---	------------	------------	------	----------	------

OBLIGATIONS A TAUX FIXE NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE

CUMUL (EUR)

1,030,404.80

1,034,115.99

0.00

3,711.19 5.48

II - TITRES DE CREANCES

TITRES DE CREANCES NEGOCIEES SUR MARCHE REGLEMENTE OU ASSIMILE

BONS DU TRESOR

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FR0128984012	FRAN TREA ZCP 06-26	NOL DEPOSI (999) 170626	1,000,000.	EUR	0.	29/05/26	1.97	4	997,208.01	999,015.97	0.00	1,807.96	5.30
		NOL (999) 170626	100,000.	EUR	99.7208	29/05/26	1.97	4	99,720.80	99,901.60	0.00	180.80	0.53
FR0129132728	FREN REPU ZCP 07-26	NOL (999) 150726	200,000.	EUR	99.7028	29/05/26	2.153	4	199,405.66	199,451.30	0.00	45.64	1.06
FR0129287290	FREN REPU ZCP 06-26	NOL (999) 030626	1,000,000.	EUR	0.	29/05/26	1.98	4	995,939.80	999,780.05	0.00	3,840.25	5.30
FR0129287308	FREN REPU ZCP 07-26	NOL (999) 010726	1,500,000.	EUR	99.7592	29/05/26	2.095	4	1,496,387.97	1,497,211.86	0.00	823.89	7.94
FR0129437523	FREN REPU ZCP 06-26	NOL DEPOSI (999) 240626	1,500,000.	EUR	0.	29/05/26	2.023	4	1,495,783.59	1,497,895.66	0.00	2,112.07	7.94
FR0129437531	FRAN GOVE ZCP 07-26	NOL DEPOSI (999) 080726	1,000,000.	EUR	0.	29/05/26	2.14	4	997,530.45	997,687.03	0.00	156.58	5.29
		NOL (999) 080726	500,000.	EUR	99.753	29/05/26	2.14	4	498,765.22	498,843.51	0.00	78.29	2.65

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CUMUL (EUR)

6,780,741.50

6,789,786.98

0.00

9,045.48 36.01

DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

US912797TU14	UNIT STAT ZCP 06-26	NOL (999) 020626	1,150,000.	USD	99.5276	29/05/26	3.56665	4	969,522.68	985,182.14	0.00	15,659.46	5.23
--------------	---------------------	------------------	------------	-----	---------	----------	---------	---	------------	------------	------	-----------	------

BONS DU TRESOR

CUMUL (EUR)

7,750,264.18

7,774,969.12

0.00

24,704.94 41.24

TITRES NEGOCIABLES A COURT TERME (NEU CP) EMIS PAR DES EMETTEURS NON FINANCIERS

DEVISE VALEUR : EUR EURO

ITCN13154102	AIR LI 160726	NOL (999) 160726	1,000,000.	EUR	2.215	29/05/26	2.27865667		992,670.78	997,033.91	0.00	4,363.13	5.29
--------------	---------------	------------------	------------	-----	-------	----------	------------	--	------------	------------	------	----------	------

TITRES NEGOCIABLES A COURT TERME (NEU CP) EMIS PAR DES EMETTEURS BANCAIRES

DEVISE VALEUR : EUR EURO

ITCN13427814	GOLDMA 020626	NOL (999) 020626	1,500,000.	EUR	2.045	29/05/26	2.043925		1,498,808.03	1,499,744.55	0.00	936.52	7.95
--------------	---------------	------------------	------------	-----	-------	----------	----------	--	--------------	--------------	------	--------	------

DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

ITCN13159535	MI ZUHO 030726	NOL (999) 030726	1,000,000.	USD	3.92	29/05/26	3.92	X	857,852.72	853,773.88	0.00	-4,078.84	4.53
ITCN13177104	INDU BANK ZCP 08-26	NOL (999) 120826	500,000.	USD	3.93	29/05/26	2.31428097		426,522.67	426,438.75	0.00	-83.92	2.26

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

CUMUL (EUR)

1,284,375.39

1,280,212.63

0.00

-4,162.76 6.79

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 29/05/26

PORTEFEUILLE : 050812 AMUNDI VOLATILITY RISK PREMIA

VL VALIDEE

Devise de fixing : FXR Devises Reuters

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	Devise du portefeuille				PRCT ACT NET
									<-----> PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL	
TITRES NEGOCIABLES A COURT TERME (NEU CP) EMIS PAR DES EMETTEURS BANCAIRES													
CUMUL (EUR)									2,783,183.42	2,779,957.18	0.00	-3,226.24	14.74
TITRES DE CREANCES NEGOCIES SUR MARCHÉ REGLEMENTE OU ASSIMILE													
CUMUL (EUR)									11,526,118.38	11,551,960.21	0.00	25,841.83	61.27
III - TITRES D OPC													
OPCVM ET EQUIVALENTS D AUTRES ETATS MEMBRE DE L UE													
DEVISE VALEUR : EUR EURO													
FR0014005XL2	AM EUR LIQ ST RESP Z		1.173	P EUR	110271.3555	M 31/05/26	110396.5682	5	129,348.30	129,495.17	0.00	146.87	0.69
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US													
LU0619623019	Amund MM Sh USD OVC		1,139.893	P USD	1301.7889	M 29/05/26	1302.260632	5	1,272,649.77	1,272,066.31	0.00	-583.46	6.75
IV - OPERATIONS TEMPORAIRES SUR TITRES													
CREANCE REPRESENTATIVE DE TITRES RECUS EN PENSION													
DEVISE VALEUR : EUR EURO													
10C127247667	NATU FI 3.25 10-30	PPLIV 0.13 270726	605,820.	EUR	0.	% 29/05/26			0.00	1,144.28	1,144.28	1,144.28	0.01
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US													
10C127146033	TELS GR 3.25 11-27	PPLIV 0.1 220726	499,800.	USD	0.	% 29/05/26			0.00	1,672.62	1,672.62	1,672.62	0.01
VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHES A TERME													
ENGAGEMENTS A TERME FERMES													
FUTURES SUR INDICES													
DEVISE COTATION : EUR EURO													
FINL000001VX	EURO STOXX 50 0626		5.	EUR	6057.	M 29/05/26	6064.	4	0.00	350.00	0.00	350.00	0.00
DEVISE COTATION : JPY YEN													
FINL0000000M	ONK TOKYO NIK 0626		-2.	JPY	64270.	M 29/05/26	66470.	4	0.00	-23,685.61	0.00	-23,685.61	-0.13
DEVISE COTATION : USD DOLLAR US													
FINL0000000P	SP 500 MINI 0626		-14.	USD	7471.9643	M 29/05/26	7595.75	4	0.00	-74,253.40	0.00	-74,253.40	-0.39
FUTURES SUR INDICES													
CUMUL (EUR)									0.00	-97,589.01	0.00	-97,589.01	-0.52
ENGAGEMENTS A TERME CONDITIONNELS													

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 29/05/26

PORTEFEUILLE : 050812 AMUNDI VOLATILITY RISK PREMIA

VL VALIDEE

Devise de fixing : FXR Devises Reuters

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	Devise du portefeuille				PRCT ACT NET	
									<-----> PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	>-----< PLUS OU MOINS VAL		
OPTIONS SUR INDICES - MARCHÉ RÉGLEMENTÉ														
						CUMUL (EUR)				1,016,148.93	905,057.35	0.00	-111,091.58	4.80
VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHÉS À TERME														
						CUMUL (EUR)				1,016,148.93	807,468.34	0.00	-208,680.59	4.28
IX - TRÉSORERIE														
DETTES ET CRÉANCES														
COLLATERAL CASH SUR DÉRIVÉS LISTES														
DGMCIJPY	Dépôt gar.	CACEIS BK	15,242,093.	JPY	0.00539233	29/05/26	0.00538309			82,190.43	82,049.61	0.00	-140.82	0.44
DGMCIUSD	Dépôt gar.	CACEIS BK	3,225,948.47	USD	0.85760762	29/05/26	0.85693474			2,766,597.98	2,764,427.33	0.00	-2,170.65	14.66
						CUMUL (EUR)				2,848,788.41	2,846,476.94	0.00	-2,311.47	15.10
APPELS DE MARGE														
MARCI EUR	Appel Marge	CACEIS	-350.	EUR	1.	29/05/26	1.			-350.00	-350.00	0.00	0.00	0.00
MARCI JPY	Appel Marge	CACEIS	4,400,000.	JPY	0.00538541	29/05/26	0.00538309			23,695.79	23,685.61	0.00	-10.18	0.13
MARCI USD	Appel Marge	CACEIS	86,649.73	USD	0.85999172	29/05/26	0.85693474			74,518.05	74,253.16	0.00	-264.89	0.39
						CUMUL (EUR)				97,863.84	97,588.77	0.00	-275.07	0.52
FRAIS DE GESTION														
FGPVAEUR	Frais de Gest.	Admi	-2,399.13	EUR	1.	29/05/26	1.			-2,399.13	-2,399.13	0.00	0.00	-0.01
FGPVFEUR	Frais de Gest.	Fixe	-8,618.71	EUR	1.	29/05/26	1.			-8,618.71	-8,618.71	0.00	0.00	-0.05
						CUMUL (EUR)				-11,017.84	-11,017.84	0.00	0.00	-0.06
AUTRES DETTES ET CRÉANCES														
FRTOEUR	Frais RTO		-47.8	EUR	1.	29/05/26	1.			-47.80	-47.80	0.00	0.00	0.00
DETTES ET CRÉANCES														
						CUMUL (EUR)				2,935,586.61	2,933,000.07	0.00	-2,586.54	15.56
DISPONIBILITÉS														
AVOIRS														
BQCI CHF	CACEIS	Bank	7,950.38	CHF	1.01487476	29/05/26	1.09673174			8,068.64	8,719.43	0.00	650.79	0.05
BQCI EUR	CACEIS	Bank	71,289.09	EUR	1.	29/05/26	1.			71,289.09	71,289.09	0.00	0.00	0.38
BQCI HKD	CACEIS	Bank	1,065.28	HKD	0.10828139	29/05/26	0.10933921			115.35	116.48	0.00	1.13	0.00
BQCI JPY	CACEIS	Bank	76,686,904.	JPY	0.00540059	29/05/26	0.00538309			414,154.79	412,812.75	0.00	-1,342.04	2.19
BQCI USD	CACEIS	Bank	738,743.01	USD	0.85693473	29/05/26	0.85693474			633,054.54	633,054.55	0.00	0.01	3.36
						CUMUL (EUR)				1,126,682.41	1,125,992.30	0.00	-690.11	5.97

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 29/05/26

PORTEFEUILLE : 050812 AMUNDI VOLATILITY RISK PREMIA

VL VALIDEE

Devise de fixing : FXR Devises Reuters

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET		DEV COT	P. R. U EN DEVISE		DATE COTA	COURS VALEUR	I F	Devise du portefeuille				PRCT ACT NET	
			EXPR.	QUANTITE		ET EXPR.	COURS				<-----> PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL		
CHANGE A TERME ET SWAP DE CHANGE																
DEVISE COTATION : JPY YEN																
I CAT0002DH52	A/EUR/JPY/20260611	RECU	11/06/26	300,501.29	EUR	182.8611	29/05/26	185.70373503			300,501.29	300,399.27	0.00	-102.02	1.59	
		VERSE	11/06/26	-54,950,000.	JPY	1.	29/05/26	1.			-300,501.29	-295,800.97	0.00	4,700.32	-1.57	
I CAT0002E8GL	A/EUR/JPY/20260611	RECU	11/06/26	250,000.	EUR	182.6205	29/05/26	185.70373503			250,000.00	249,915.13	0.00	-84.87	1.33	
		VERSE	11/06/26	-45,655,122.	JPY	1.	29/05/26	1.			-250,000.00	-245,765.78	0.00	4,234.22	-1.30	
SOUS TOTAL DEVISE COTATION : JPY YEN																
											CUMUL (EUR)	0.00	8,747.65	0.00	8,747.65	0.05
DEVISE COTATION : USD DOLLAR US																
I CAT0002DH51	A/EUR/USD/20260611	RECU	11/06/26	7,400,720.74	EUR	1.1702	29/05/26	1.167429			7,400,720.74	7,403,758.52	0.00	3,037.78	39.27	
		VERSE	11/06/26	-8,660,000.	USD	1.	29/05/26	1.			-7,400,720.74	-7,421,054.89	0.00	-20,334.15	-39.36	
I CAT0002E8GM	A/EUR/USD/20260611	RECU	11/06/26	400,000.	EUR	1.1507	29/05/26	1.167429			400,000.00	400,164.19	0.00	164.19	2.12	
		VERSE	11/06/26	-460,279.48	USD	1.	29/05/26	1.			-400,000.00	-394,429.48	0.00	5,570.52	-2.09	
SOUS TOTAL DEVISE COTATION : USD DOLLAR US																
											CUMUL (EUR)	0.00	-11,561.66	0.00	-11,561.66	-0.06
CHANGE A TERME ET SWAP DE CHANGE																
											CUMUL (EUR)	0.00	-2,814.01	0.00	-2,814.01	-0.01
DISPONIBILITES																
											CUMUL (EUR)	1,126,682.41	1,123,178.29	0.00	-3,504.12	5.96
IX - TRESORERIE																
											CUMUL (EUR)	4,062,269.02	4,056,178.36	0.00	-6,090.66	21.51
PORTEFEUILLE : AMUNDI VOLATILITY RISK PREMIA (050812)																
											(EUR)	19,036,939.20	18,854,101.28	2,816.90	-182,837.92	100.00

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 29/05/26

PORTEFEUILLE : 050812 AMUNDI VOLATILITY RISK PREMIA

VL VALIDEE

Devise de fixing : FXR Devises Reuters

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR , Tris : BVAL04)

Portefeuille titres : 14,795,108.91

Frais de gestion du jour

Frais de Gest. Admi :	1.62	EUR
Frais de Gest. Admi :	22.47	EUR
Frais de Gest. Admi :	15.99	EUR
Frais de Gest. Fixe :	8.84	EUR
Frais de Gest. Fixe :	31.98	EUR
Frais de Gest. Fixe :	102.99	EUR

Frais de gestion charge Entreprise

FRAIS MAXIMUM NOTICE :	10.46	EUR
FRAIS MAXIMUM NOTICE :	47.97	EUR
FRAIS MAXIMUM NOTICE :	131.08	EUR

Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
C0 FR0010191866 AMUN VOLA RISK PRE P	EUR	347,022.81	3,171.794	109.40	1.84060688005			110.49	109.40
C2 FR0013432663 AM. VOL. RISK PREM. O-C	EUR	11,672,428.35	1,167.794	9,995.28	61.908877557459			9,995.28	9,995.28
C1 FR0010144568 AMUNDI VOLA RISK I	EUR	6,834,650.12	1,154.983	5,917.53	36.250515562491			5,917.53	5,917.53

Actif net total en EUR : 18,854,101.28

Precedente VL en date du 28/05/26 :

C0	AMUN VOLA RISK PRE P	Prec. VL :	109.46	(EUR)	Variation :	-0.055%
C2	AM. VOL. RISK PREM. O-C	Prec. VL :	9,999.96	(EUR)	Variation :	-0.047%
C1	AMUNDI VOLA RISK I	Prec. VL :	5,920.38	(EUR)	Variation :	-0.048%

VL theorique

Part	Devise	Actif theorique	Valeur liquidative theorique
C0 FR0010191866 AMUN VOLA RISK PRE P	EUR	347,022.81	109.40
C2 FR0013432663 AM. VOL. RISK PREM. O-C	EUR	11,672,428.35	9,995.28
C1 FR0010144568 AMUNDI VOLA RISK I	EUR	6,834,650.12	5,917.53

Actif theorique total en EUR : 18,854,101.28 (Sens collecte : EQU)

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 29/05/26

PORTEFEUILLE : 050812 AMUNDI VOLATILITY RISK PREMIA

VL VALIDEE

Devise de fixing : FXR Devises Reuters

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TYPE D INSTRUMENT DETAILLE / DEVISE VALEUR , Tris : BVAL04)

COURS DES DEVICES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente		variation	
Cours EUR en CHF :	0.9118	cotation :	29/05/26	0.	0.91415	cotation :	28/05/26	-0.25707
Cours EUR en HKD :	9.14585	cotation :	29/05/26	0.	9.126	cotation :	28/05/26	0.21751
Cours EUR en JPY :	185.7668	cotation :	29/05/26	0.	185.4573	cotation :	28/05/26	0.16688
Cours EUR en USD :	1.16695	cotation :	29/05/26	0.	1.16475	cotation :	28/05/26	0.18888

COURS INVERSES DES DEVICES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente		
Cours CHF en EUR :	1.0967317394	cotation :	29/05/26	0.	1.0939123776	cotation :	28/05/26
Cours HKD en EUR :	0.1093392085	cotation :	29/05/26	0.	0.1095770327	cotation :	28/05/26
Cours JPY en EUR :	0.0053830932	cotation :	29/05/26	0.	0.0053920768	cotation :	28/05/26
Cours USD en EUR :	0.8569347444	cotation :	29/05/26	0.	0.8585533376	cotation :	28/05/26