



AXA INDICE EURO

**RAPPORT DU COMMISSAIRE AUX COMPTES
SUR LES COMPTES ANNUELS
Exercice clos le 30 septembre 2022**



**RAPPORT DU COMMISSAIRE AUX COMPTES
SUR LES COMPTES ANNUELS
Exercice clos le 30 septembre 2022**

AXA INDICE EURO
OPCVM CONSTITUE SOUS FORME DE FONDS COMMUN DE PLACEMENT
Régis par le Code monétaire et financier

Société de gestion
ARCHITAS France
313 Terrasses de l'Arche
92727 Nanterre Cedex

Opinion

En exécution de la mission qui nous a été confiée par la société de gestion, nous avons effectué l'audit des comptes annuels de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement AXA INDICE EURO relatifs à l'exercice clos le 30 septembre 2022, tels qu'ils sont joints au présent rapport.

Nous certifions que les comptes annuels sont, au regard des règles et principes comptables français, réguliers et sincères et donnent une image fidèle du résultat des opérations de l'exercice écoulé ainsi que de la situation financière et du patrimoine de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement à la fin de cet exercice.

Fondement de l'opinion

Référentiel d'audit

Nous avons effectué notre audit selon les normes d'exercice professionnel applicables en France. Nous estimons que les éléments que nous avons collectés sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion. Les responsabilités qui nous incombent en vertu de ces normes sont indiquées dans la partie « *Responsabilités du commissaire aux comptes relatives à l'audit des comptes annuels* » du présent rapport.

Indépendance

Nous avons réalisé notre mission d'audit dans le respect des règles d'indépendance prévues par le code de commerce et par le code de déontologie de la profession de commissaire aux comptes, sur la période du 01/10/2021 à la date d'émission de notre rapport.

*PricewaterhouseCoopers Audit, 63, rue de Villiers, 92208 Neuilly-sur-Seine Cedex
T: +33 (0) 1 56 57 58 59, F: +33 (0) 1 56 57 58 60, www.pwc.fr*

Société d'expertise comptable inscrite au tableau de l'ordre de Paris - Ile de France. Société de commissariat aux comptes membre de la compagnie régionale de Versailles. Société par Actions Simplifiée au capital de 2 510 460 €. Siège social : 63, rue de Villiers 92200 Neuilly-sur-Seine. RCS Nanterre 672 006 483. TVA n° FR 76 672 006 483. Siret 672 006 483 00362. Code APE 6920 Z. Bureaux : Bordeaux, Grenoble, Lille, Lyon, Marseille, Metz, Nantes, Nice, Paris, Poitiers, Rennes, Rouen, Strasbourg, Toulouse.



AXA INDICE EURO

Justification des appréciations

En application des dispositions des articles L.823-9 et R.823-7 du code de commerce relatives à la justification de nos appréciations, nous portons à votre connaissance que les appréciations qui, selon notre jugement professionnel ont été les plus importantes pour l'audit des comptes annuels de l'exercice, ont porté sur le caractère approprié des principes comptables appliqués ainsi que sur le caractère raisonnable des estimations significatives retenues et sur la présentation d'ensemble des comptes.

Les appréciations ainsi portées s'inscrivent dans le contexte de l'audit des comptes annuels pris dans leur ensemble et de la formation de notre opinion exprimée ci-avant. Nous n'exprimons pas d'opinion sur des éléments de ces comptes annuels pris isolément.

Vérifications spécifiques

Nous avons également procédé, conformément aux normes d'exercice professionnel applicables en France, aux vérifications spécifiques prévues par les textes légaux et réglementaires.

Nous n'avons pas d'observation à formuler sur la sincérité et la concordance avec les comptes annuels des informations données dans le rapport de gestion établi par la société de gestion.

*PricewaterhouseCoopers Audit, 63, rue de Villiers, 92208 Neuilly-sur-Seine Cedex
T: +33 (0) 1 56 57 58 59, F: +33 (0) 1 56 57 58 60, www.pwc.fr*

Société d'expertise comptable inscrite au tableau de l'ordre de Paris - Ile de France. Société de commissariat aux comptes membre de la compagnie régionale de Versailles. Société par Actions Simplifiée au capital de 2 510 460 €. Siège social : 63, rue de Villiers 92200 Neuilly-sur-Seine. RCS Nanterre 672 006 483. TVA n° FR 76 672 006 483. Siret 672 006 483 00362. Code APE 6920 Z. Bureaux : Bordeaux, Grenoble, Lille, Lyon, Marseille, Metz, Nantes, Nice, Paris, Poitiers, Rennes, Rouen, Strasbourg, Toulouse.

Responsabilités de la société de gestion relatives aux comptes annuels

Il appartient à la société de gestion d'établir des comptes annuels présentant une image fidèle conformément aux règles et principes comptables français ainsi que de mettre en place le contrôle interne qu'elle estime nécessaire à l'établissement de comptes annuels ne comportant pas d'anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs.

Lors de l'établissement des comptes annuels, il incombe à la société de gestion d'évaluer la capacité du fonds à poursuivre son exploitation, de présenter dans ces comptes, le cas échéant, les informations nécessaires relatives à la continuité d'exploitation et d'appliquer la convention comptable de continuité d'exploitation, sauf s'il est prévu de liquider le fonds ou de cesser son activité.

Les comptes annuels ont été établis par la société de gestion.

Responsabilités du commissaire aux comptes relatives à l'audit des comptes annuels

Objectif et démarche d'audit

Il nous appartient d'établir un rapport sur les comptes annuels. Notre objectif est d'obtenir l'assurance raisonnable que les comptes annuels pris dans leur ensemble ne comportent pas d'anomalies significatives. L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, sans toutefois garantir qu'un audit réalisé conformément aux normes d'exercice professionnel permet de systématiquement détecter toute anomalie significative. Les anomalies peuvent provenir de fraudes ou résulter d'erreurs et sont considérées comme significatives lorsque l'on peut raisonnablement s'attendre à ce qu'elles puissent, prises individuellement ou en cumulé, influencer les décisions économiques que les utilisateurs des comptes prennent en se fondant sur ceux-ci.

Comme précisé par l'article L.823-10-1 du code de commerce, notre mission de certification des comptes ne consiste pas à garantir la viabilité ou la qualité de la gestion du fonds.

Dans le cadre d'un audit réalisé conformément aux normes d'exercice professionnel applicables en France, le commissaire aux comptes exerce son jugement professionnel tout au long de cet audit. En outre :

- il identifie et évalue les risques que les comptes annuels comportent des anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs, définit et met en œuvre des procédures d'audit face à ces risques, et recueille des éléments qu'il estime suffisants et appropriés pour fonder son opinion. Le risque de non-détection d'une anomalie significative provenant d'une fraude est plus élevé que celui d'une anomalie significative résultant d'une erreur, car la fraude peut impliquer la collusion, la falsification, les omissions volontaires, les fausses déclarations ou le contournement du contrôle interne ;

*PricewaterhouseCoopers Audit, 63, rue de Villiers, 92208 Neuilly-sur-Seine Cedex
T: +33 (0) 1 56 57 58 59, F: +33 (0) 1 56 57 58 60, www.pwc.fr*



AXA INDICE EURO

- il prend connaissance du contrôle interne pertinent pour l'audit afin de définir des procédures d'audit appropriées en la circonstance, et non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne ;
- il apprécie le caractère approprié des méthodes comptables retenues et le caractère raisonnable des estimations comptables faites par la société de gestion, ainsi que les informations les concernant fournies dans les comptes annuels ;
- il apprécie le caractère approprié de l'application par la société de gestion de la convention comptable de continuité d'exploitation et, selon les éléments collectés, l'existence ou non d'une incertitude significative liée à des événements ou à des circonstances susceptibles de mettre en cause la capacité du fonds à poursuivre son exploitation. Cette appréciation s'appuie sur les éléments collectés jusqu'à la date de son rapport, étant toutefois rappelé que des circonstances ou événements ultérieurs pourraient mettre en cause la continuité d'exploitation. S'il conclut à l'existence d'une incertitude significative, il attire l'attention des lecteurs de son rapport sur les informations fournies dans les comptes annuels au sujet de cette incertitude ou, si ces informations ne sont pas fournies ou ne sont pas pertinentes, il formule une certification avec réserve ou un refus de certifier ;
- il apprécie la présentation d'ensemble des comptes annuels et évalue si les comptes annuels reflètent les opérations et événements sous-jacents de manière à en donner une image fidèle.

En application de la loi, nous vous signalons que nous n'avons pas été en mesure d'émettre le présent rapport dans les délais réglementaires compte tenu de la réception tardive de certains documents nécessaires à la finalisation de nos travaux.

Neuilly sur Seine, date de la signature électronique

Document authentifié par signature électronique
Le commissaire aux comptes
PricewaterhouseCoopers Audit
Amaury Couplez

Bilan actif

| | Exercice 30/09/2022 | Exercice 30/09/2021 |
|---|------------------------|------------------------|
| Immobilisations Nettes | - | - |
| Dépôts | - | - |
| Instruments financiers | 136,258,681.52 | 209,449,262.01 |
| Actions et valeurs assimilées | 132,028,216.66 | 201,984,274.37 |
| Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé | 132,028,216.66 | 201,984,274.37 |
| Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé | - | - |
| Obligations et valeurs assimilées | - | - |
| Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé | - | - |
| Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé | - | - |
| Titres de créances | - | 80,219.24 |
| Négoiciés sur un marché réglementé ou assimilé - Titres de créances négociables | - | 80,219.24 |
| Négoiciés sur un marché réglementé ou assimilé - Autres titres de créances | - | - |
| Non négoiciés sur un marché réglementé ou assimilé | - | - |
| Titres d'organismes de placement collectif | 4,230,464.86 | 6,602,630.81 |
| OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'Union Européenne | 4,230,464.86 | 6,602,630.81 |
| Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'Union Européenne | - | - |
| Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres pays Etats membres de l'Union Européenne et organismes de titrisations cotés | - | - |
| Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'Union Européenne et organismes de titrisations non cotés | - | - |
| Autres organismes non européens | - | - |
| Opérations temporaires sur titres | - | 782,137.59 |
| Créances représentatives de titre reçus en pension | - | - |
| Créances représentatives de titres prêtés | - | - |
| Titres empruntés | - | - |
| Titres donnés en pension | - | - |
| Autres opérations temporaires | - | 782,137.59 |
| Instruments financiers à terme | - | - |
| Opérations sur un marché réglementé ou assimilé | - | - |
| Autres opérations | - | - |
| Autres Actifs : Loans | - | - |
| Autres instruments financiers | - | - |
| Créances | 638,306.61 | 125,037.77 |
| Opérations de change à terme de devises | - | - |
| Autres | 638,306.61 | 125,037.77 |
| Comptes financiers | 707,019.80 | 729,053.39 |
| Liquidités | 707,019.80 | 729,053.39 |
| TOTAL DE L'ACTIF | 137,604,007.93 | 210,303,353.17 |

Bilan passif

| | Exercice 30/09/2022 | Exercice 30/09/2021 |
|---|------------------------|------------------------|
| Capitaux propres | - | - |
| Capital | 121,894,712.04 | 200,252,971.92 |
| Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées (a) | - | - |
| Report à nouveau (a) | 64.08 | 16.49 |
| Plus et moins-values nettes de l'exercice (a,b) | 12,599,640.60 | 7,517,695.21 |
| Résultat de l'exercice (a,b) | 2,944,082.89 | 2,275,221.20 |
| Total capitaux propres (= Montant représentatif de l'actif net) | 137,438,499.61 | 210,045,904.82 |
| Instruments financiers | - | - |
| Opérations de cession sur instruments financiers | - | - |
| Opérations temporaires sur titres | - | - |
| Dettes représentatives de titres donnés en pension | - | - |
| Dettes représentatives de titres empruntés | - | - |
| Autres opérations temporaires | - | - |
| Instruments financiers à terme | - | - |
| Opérations sur un marché réglementé ou assimilé | - | - |
| Autres opérations | - | - |
| Dettes | 165,508.32 | 257,448.35 |
| Opérations de change à terme de devises | - | - |
| Autres | 165,508.32 | 257,448.35 |
| Comptes financiers | - | - |
| Concours bancaires courants | - | - |
| Emprunts | - | - |
| TOTAL DU PASSIF | 137,604,007.93 | 210,303,353.17 |

(a) Y compris comptes de régularisations.

(b) Diminués des acomptes versés au titre de l'exercice.

Hors-bilan

| | Exercice 30/09/2022 | Exercice 30/09/2021 |
|--|------------------------|------------------------|
| Opérations de couverture | | |
| Engagements sur marchés réglementés ou assimilés | | |
| Engagements de gré à gré | | |
| Autres engagements | | |
| Autres opérations | | |
| Engagements sur marchés réglementés ou assimilés | | |
| Futures | | |
| achat EURO STOXX 50 - FUTURE 16/12/2022 | 5,138,250.00 | - |
| achat EURO STOXX 50 - FUTURE 17/12/2021 | - | 8,015,040.00 |
| Engagements de gré à gré | | |
| Autres engagements | | |

Compte de résultat

| | Exercice 30/09/2022 | Exercice 30/09/2021 |
|---|------------------------|------------------------|
| Produits sur opérations financières | - | - |
| Produits sur actions et valeurs assimilées | 4,622,004.00 | 4,178,513.19 |
| Produits sur obligations et valeurs assimilées | - | - |
| Produits sur titres de créances | - | - |
| Produits sur acquisitions et cessions temporaires de titres | - | - |
| Produits sur instruments financiers à terme | - | - |
| Produits sur dépôts et sur comptes financiers | 242.21 | 10.82 |
| Produits sur prêts | - | - |
| Autres produits financiers | - | - |
| TOTAL I | 4,622,246.21 | 4,178,524.01 |
| Charges sur opérations financières | - | - |
| Charges sur acquisitions et cessions temporaires de titres | - | - |
| Charges sur instruments financiers à terme | - | - |
| Charges sur dettes financières | -4,536.47 | -3,153.91 |
| Autres charges financières | - | - |
| TOTAL II | -4,536.47 | -3,153.91 |
| Résultat sur opérations financières (I + II) | 4,617,709.74 | 4,175,370.10 |
| Autres produits (III) | - | - |
| Frais de gestion et dotations aux amortissements (IV) | -1,541,681.97 | -1,852,924.03 |
| Résultat net de l'exercice (I + II + III + IV) | 3,076,027.77 | 2,322,446.07 |
| Régularisation des revenus de l'exercice (V) | -131,944.88 | -47,224.87 |
| Acomptes sur résultat versés au titre de l'exercice (VI) | - | - |
| Résultat (I + II + III + IV + V + VI) | 2,944,082.89 | 2,275,221.20 |

Règles et Méthodes Comptables

Les comptes annuels sont présentés sous la forme prévue par le règlement ANC n° 2014-01 du 14 Janvier 2014, modifié.

La devise de comptabilité est l'Euro.

Toutes les valeurs mobilières qui composent le portefeuille ont été comptabilisées au coût historique, frais exclus.

Les titres et instruments financiers à terme ferme et conditionnel détenus en portefeuille libellés en devises sont convertis dans la devise de comptabilité sur la base des taux de change relevés à Paris au jour de l'évaluation.

Le portefeuille est évalué lors de chaque valeur liquidative et lors de l'arrêté des comptes selon les méthodes suivantes :

Valeurs mobilières

Les titres cotés : à la valeur boursière - coupons courus inclus (cours clôture jour)

Toutefois, les valeurs mobilières dont le cours n'a pas été constaté le jour de l'évaluation, ou cotées par des contributeurs et pour lequel le cours a été corrigé, de même que les titres qui ne sont pas négociés sur un marché réglementé, sont évalués sous la responsabilité de la société de gestion (ou du conseil d'administration pour une Sicav), à leur valeur probable de négociation. Les prix sont corrigés par la société de gestion en fonction de sa connaissance des émetteurs et/ou des marchés.

Les O.P.C. : à la dernière valeur liquidative connue, à défaut à la dernière valeur estimée. Les valeurs liquidatives des titres d'organismes de placements collectifs étrangers valorisant sur une base mensuelle, sont confirmées par les administrateurs de fonds. Les valorisations sont mises à jour de façon hebdomadaire sur la base d'estimations communiquées par les administrateurs de ces OPC et validées par le gérant.

Les ETF : à la dernière valeur liquidative connue, à défaut à la dernière valeur estimée.

Les titres de créances et assimilés négociables qui ne font pas l'objet de transactions significatives sont évalués par l'application d'une méthode actuarielle, le taux retenu étant celui applicable à des émissions de titres équivalents affecté, le cas échéant, d'un écart représentatif des caractéristiques intrinsèques de l'émetteur. En l'absence de sensibilité, les titres d'une durée résiduelle égale à trois mois sont valorisés au dernier taux jusqu'à l'échéance et ceux acquis à moins de trois mois, les intérêts sont linéarisés.

Les acquisitions et cessions temporaires de titres :

- Les prêts de titres : la créance représentative des titres prêtés est évaluée à la valeur du marché des titres.
- Les emprunts de titres : les titres empruntés ainsi que la dette représentative des titres empruntés sont évalués à la valeur du marché des titres.
- Les collatéraux : s'agissant des titres reçus en garantie dans le cadre des opérations de prêts de titres, l'OPC a opté pour une présentation de ces titres dans les comptes du bilan à hauteur de la dette correspondant à l'obligation de restitution de ceux-ci.
- Les pensions livrées d'une durée résiduelle inférieure ou égale à trois mois : individualisation de la créance sur la base du prix du contrat. Dans ce cas, une linéarisation de la rémunération est effectuée.
- Les pensions long terme : Elles sont enregistrées et évaluées à leur nominal, même si elles ont une échéance supérieure à trois mois. Ce montant est majoré des intérêts courus qui s'y rattachent. Toutefois, certains contrats prévoient des conditions particulières en cas de demande de remboursement anticipé afin de prendre en compte l'impact de hausse de la courbe de financement de la contrepartie. Les intérêts courus peuvent alors être diminués de cet impact, sans valeur planchée. L'impact est proportionnel à la durée résiduelle de la pension et l'écart constaté entre la marge contractuelle et la marge de marché pour une date de maturité identique.
- Les mises en pensions d'une durée résiduelle inférieure ou égale à trois mois : valeur boursière. La dette valorisée sur la base de la valeur contractuelle est inscrite au passif du bilan. Dans ce cas, une linéarisation de la rémunération est effectuée.

Instruments financiers à terme et conditionnels

Futures : cours de compensation jour.

L'évaluation hors bilan est calculée sur la base du nominal, de son cours de compensation et, éventuellement, du cours de change.

Options : cours de clôture jour ou, à défaut, le dernier cours connu.

Options OTC : ces options font l'objet d'une évaluation à leur valeur de marché, en fonction des cours communiqués par les contreparties. Ces valorisations font l'objet de contrôles par la société de gestion.

AXA INDICE EURO

L'évaluation hors bilan est calculée en équivalent sous-jacent en fonction du delta et du cours du sous-jacent et, éventuellement, du cours de change.

Cas particulier : Floor : ces options sont valorisées par des contreparties tierces à partir d'un modèle d'actualisation Marked-to-market basé sur une volatilité et une courbe de taux de marché vérifiées par le gérant et pris à la clôture du marché chaque jeudi.

Change à terme : réévaluation des devises en engagement au cours du jour en prenant en compte le report / déport calculé en fonction de l'échéance du contrat.

Dépôts à terme : ils sont enregistrés et évalués pour leur montant nominal, même s'ils ont une échéance supérieure à trois mois. Ce montant est majoré des intérêts courus qui s'y rattachent. Toutefois, certains contrats prévoient des conditions particulières en cas de demande de remboursement anticipé afin de prendre en compte l'impact de hausse de la courbe de financement de la contrepartie. Les intérêts courus peuvent alors être diminués de cet impact, sans pouvoir être négatifs. Les dépôts à terme sont alors au minimum évalués à leur valeur nominale.

Swaps de taux :

- pour les swaps d'échéance inférieure à trois mois, les intérêts sont linéarisés
- les swaps d'échéance supérieure à trois mois sont revalorisés à la valeur du marché

Les produits synthétiques (association d'un titre et d'un swap) sont comptabilisés globalement. Les intérêts des swaps à recevoir dans le cadre de ces produits sont valorisés linéairement.

Les assets swaps et les produits synthétiques sont valorisés sur la base de sa valeur de marché. L'évaluation des assets swaps est basée sur l'évaluation des titres couverts à laquelle est retranchée l'incidence de la variation des spreads de crédit. Cette incidence est évaluée à partir de la moyenne des spreads communiqués par 4 contreparties interrogées mensuellement, corrigée d'une marge, en fonction de la notation de l'émetteur.

L'engagement hors bilan des swaps correspond au nominal.

Swaps structurés (swaps à composante optionnelle) : ces swaps font l'objet d'une évaluation à leur valeur de marché, en fonction des cours communiqués par les contreparties. Ces valorisations font l'objet de contrôles par la société de gestion.

L'engagement hors bilan de ces swaps correspond à la valeur nominale.

Frais de gestion financière

- 1,50 % TTC maximum pour la part C
- 1,50 % TTC maximum pour la part D

La dotation est calculée sur la base de l'actif net. Ces frais, n'incluant pas les frais de transaction, seront directement imputés au compte de résultat du Fonds.

Ces frais recouvrent tous les frais facturés à l'OPC, à l'exception des frais de transaction. Les frais de transactions incluent les frais d'intermédiaires (courtage, impôts de bourse, ...) et la commission de mouvement, le cas échéant, qui peut être perçue notamment par le dépositaire et la société de gestion.

Frais de gestion administratifs externes à la société de gestion

- 0,10% TTC maximum pour la part C sur la base de l'actif net
- 0,10% TTC maximum pour la part D sur la base de l'actif net

Frais de recherche

Néant

Commission de surperformance

Néant

Rétrocession de frais de gestion

Néant

Méthode de comptabilisation des intérêts

Intérêts encaissés

Affectation des résultats réalisés

Capitalisation pour la part C

Distribution pour la part D

Affectation des plus-values nettes réalisées

Capitalisation pour la part C

Capitalisation et/ou Distribution pour la part D

Changements affectant le fonds

Néant

Evolution de l'actif net

| | Exercice 30/09/2022 | Exercice 30/09/2021 |
|---|------------------------|------------------------|
| Actif net en début d'exercice | 210,045,904.82 | 182,358,817.83 |
| Souscriptions (y compris les commissions de souscription acquises à l'O.P.C.) | 15,780,372.77 | 22,406,176.28 |
| Rachats (sous déduction des commissions de rachat acquises à l'O.P.C.) | -63,469,204.02 | -44,307,984.38 |
| Plus-values réalisées sur dépôts et instruments financiers | 19,414,870.52 | 10,292,278.58 |
| Moins-values réalisées sur dépôts et instruments financiers | -3,575,354.33 | -3,718,885.38 |
| Plus-values réalisées sur instruments financiers à terme | 302,487.50 | 1,439,715.00 |
| Moins-values réalisées sur instruments financiers à terme | -681,067.50 | -57,340.00 |
| Frais de transaction | -56,887.72 | -60,333.88 |
| Différences de change | 12,408.21 | 813.76 |
| Variation de la différence d'estimation des dépôts et instruments financiers : | -43,129,249.38 | 39,373,316.32 |
| Différence d'estimation exercice N | 12,062,064.81 | 55,191,314.19 |
| Différence d'estimation exercice N-1 | -55,191,314.19 | -15,817,997.87 |
| Variation de la différence d'estimation des instruments financiers à terme : | -279,795.00 | -1,185.00 |
| Différence d'estimation exercice N | -514,425.00 | -234,630.00 |
| Différence d'estimation exercice N-1 | 234,630.00 | 233,445.00 |
| Distribution de l'exercice antérieur sur plus et moins-values nettes | - | - |
| Distribution de l'exercice antérieur sur résultat | -2,014.03 | -1,930.38 |
| Résultat net de l'exercice avant compte de régularisation | 3,076,027.77 | 2,322,446.07 |
| Acompte(s) versé(s) au cours de l'exercice sur plus et moins-values nettes | - | - |
| Acompte(s) versé(s) au cours de l'exercice sur résultat | - | - |
| Autres éléments | - | - |
| Actif net en fin d'exercice | 137,438,499.61 | 210,045,904.82 |

Complément d'information 1

| | Exercice 30/09/2022 |
|---|------------------------|
| Engagements reçus ou donnés | |
| Engagements reçus ou donnés (garantie de capital ou autres engagements) (*) | - |
| Valeur actuelle des instruments financiers inscrits en portefeuille constitutifs de dépôts de garantie | |
| Instruments financiers reçus en garantie et non inscrits au bilan | - |
| Instruments financiers donnés en garantie et maintenus dans leur poste d'origine | - |
| Instruments financiers en portefeuille émis par le prestataire ou les entités de son groupe | |
| Dépôts | - |
| Actions | 2,345,356.15 |
| Titres de taux | - |
| OPC | 4,230,464.86 |
| Acquisitions et cessions temporaires sur titres | - |
| Swaps (en nominal) | - |
| Valeur actuelle des instruments financiers faisant l'objet d'une acquisition temporaire | |
| Titres acquis à réméré | - |
| Titres pris en pension | - |
| Titres empruntés | - |

(*) Pour les OPC garantis, l'information figure dans les règles et méthodes comptables.

Complément d'information 2

| | Exercice 30/09/2022 | |
|--|-------------------------|-----------------------------------|
| Emissions et rachats pendant l'exercice comptable | | |
| | Nombre de titres | |
| Catégorie de classe C (Devise: EUR) | | |
| Nombre de titres émis | 372,366.4582 | |
| Nombre de titres rachetés | 1,431,361.3467 | |
| Catégorie de classe D (Devise: EUR) | | |
| Nombre de titres émis | 79.8646 | |
| Nombre de titres rachetés | 456.2575 | |
| Commissions de souscription et/ou de rachat | | |
| | Montant (EUR) | |
| Commissions de souscription acquises à l'OPC | - | |
| Commissions de rachat acquises à l'OPC | - | |
| Commissions de souscription perçues et rétrocédées | 1.39 | |
| Commissions de rachat perçues et rétrocédées | - | |
| Frais de gestion | | |
| | Montant (EUR) | % de l'actif net moyen |
| Catégorie de classe C (Devise: EUR) | | |
| Frais de gestion et de fonctionnement (*) | 1,540,020.23 | 0.92 |
| Commissions de surperformance | - | - |
| Autres frais | - | - |
| Catégorie de classe D (Devise: EUR) | | |
| Frais de gestion et de fonctionnement (*) | 1,661.74 | 0.92 |
| Commissions de surperformance | - | - |
| Autres frais | - | - |
| Rétrocessions de frais de gestion (toutes parts confondues) | - | |

(*) Pour les OPC dont la durée d'exercice n'est pas égale à 12 mois, le pourcentage de l'actif net moyen correspond au taux moyen annualisé.

Ventilation par nature des créances et dettes

| | Exercice 30/09/2022 |
|--|------------------------|
| Ventilation par nature des créances | |
| Avoir fiscal à récupérer | |
| Déposit euros | 534,716.40 |
| Déposit autres devises | |
| Collatéraux espèces | |
| Valorisation des achats de devises à terme | |
| Contrevaleur des ventes à terme | |
| Autres débiteurs divers | |
| Coupons à recevoir | 103,590.21 |
| TOTAL DES CREANCES | 638,306.61 |
| Ventilation par nature des dettes | |
| Déposit euros | |
| Déposit autres devises | |
| Collatéraux espèces | |
| Provision charges d'emprunts | |
| Valorisation des ventes de devises à terme | |
| Contrevaleur des achats à terme | |
| Frais et charges non encore payés | 152,751.94 |
| Autres créditeurs divers | 12,756.38 |
| Provision pour risque des liquidités de marché | |
| TOTAL DES DETTES | 165,508.32 |

Ventilation par nature juridique ou économique d'instrument

| | Exercice 30/09/2022 |
|---|------------------------|
| Actif | |
| Obligations et valeurs assimilées | - |
| Obligations indexées | - |
| Obligations convertibles | - |
| Titres participatifs | - |
| Autres Obligations et valeurs assimilées | - |
| Titres de créances | - |
| Négociés sur un marché réglementé ou assimilé | - |
| Bons du Trésor | - |
| Autres TCN | - |
| Autres Titres de créances | - |
| Non négociés sur un marché réglementé ou assimilé | - |
| Autres actifs : Loans | - |
| Passif | |
| Opérations de cession sur instruments financiers | - |
| Actions | - |
| Obligations | - |
| Autres | - |
| Hors-bilan | |
| Opérations de couverture | |
| Taux | - |
| Actions | - |
| Autres | - |
| Autres opérations | |
| Taux | - |
| Actions | 5,138,250.00 |
| Autres | - |

Ventilation par nature de taux des postes d'actif, de passif et de hors-bilan

| | Taux fixe | Taux variable | Taux révisable | Autres |
|-----------------------------------|-----------|---------------|----------------|------------|
| Actif | | | | |
| Dépôts | - | - | - | - |
| Obligations et valeurs assimilées | - | - | - | - |
| Titres de créances | - | - | - | - |
| Opérations temporaires sur titres | - | - | - | - |
| Autres actifs: Loans | - | - | - | - |
| Comptes financiers | - | - | - | 707,019.80 |
| Passif | | | | |
| Opérations temporaires sur titres | - | - | - | - |
| Comptes financiers | - | - | - | - |
| Hors-bilan | | | | |
| Opérations de couverture | - | - | - | - |
| Autres opérations | - | - | - | - |

Ventilation par maturité résiduelle des postes d'actif, de passif et de hors-bilan

| | [0 - 3 mois] |]3 mois - 1 an] |]1 - 3 ans] |]3 - 5 ans] | > 5 ans |
|-----------------------------------|--------------|-----------------|-------------|-------------|---------|
| Actif | | | | | |
| Dépôts | - | - | - | - | - |
| Obligations et valeurs assimilées | - | - | - | - | - |
| Titres de créances | - | - | - | - | - |
| Opérations temporaires sur titres | - | - | - | - | - |
| Autres actifs: Loans | - | - | - | - | - |
| Comptes financiers | 707,019.80 | - | - | - | - |
| Passif | | | | | |
| Opérations temporaires sur titres | - | - | - | - | - |
| Comptes financiers | - | - | - | - | - |
| Hors-bilan | | | | | |
| Opérations de couverture | - | - | - | - | - |
| Autres opérations | - | - | - | - | - |

Ventilation par devise de cotation des postes d'actif, de passif et de hors-bilan

| | USD | GBP |
|--|-----------|--------|
| Actif | | |
| Dépôts | - | - |
| Actions et valeurs assimilées | - | - |
| Obligations et valeurs assimilées | - | - |
| Titres de créances | - | - |
| Titres d'OPC | - | - |
| Opérations temporaires sur titres | - | - |
| Autres actifs: Loans | - | - |
| Autres instruments financiers | - | - |
| Créances | 8,096.28 | - |
| Comptes financiers | 33,024.59 | 313.02 |
| Passif | | |
| Opérations de cession sur instruments financiers | - | - |
| Opérations temporaires sur titres | - | - |
| Dettes | - | - |
| Comptes financiers | - | - |
| Hors-bilan | | |
| Opérations de couverture | - | - |
| Autres opérations | - | - |

Seules les cinq devises dont le montant le plus représentatif composant l'actif net sont incluses dans ce tableau.

Affectation des résultats

Catégorie de classe C (Devise: EUR)

Tableau d'affectation des sommes distribuables afférentes au résultat

| | Exercice 30/09/2022 | Exercice 30/09/2021 |
|---|------------------------|------------------------|
| Sommes restant à affecter | | |
| Report à nouveau | - | - |
| Résultat | 2,940,838.57 | 2,273,128.93 |
| Total | 2,940,838.57 | 2,273,128.93 |
| Affectation | | |
| Distribution | - | - |
| Report à nouveau de l'exercice | - | - |
| Capitalisation | 2,940,838.57 | 2,273,128.93 |
| Total | 2,940,838.57 | 2,273,128.93 |
| Information relative aux titres ouvrant droit à distribution | | |
| Nombre de titres | - | - |
| Distribution unitaire | - | - |
| Crédits d'impôt et avoirs fiscaux attachés à la distribution du résultat | | |
| Montant global des crédits d'impôt et avoirs fiscaux: | | |
| provenant de l'exercice | - | - |
| provenant de l'exercice N-1 | - | - |
| provenant de l'exercice N-2 | - | - |
| provenant de l'exercice N-3 | - | - |
| provenant de l'exercice N-4 | - | - |

Tableau d'affectation des sommes distribuables afférentes aux plus et moins-values nettes

| | Exercice 30/09/2022 | Exercice 30/09/2021 |
|---|------------------------|------------------------|
| Sommes restant à affecter | | |
| Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées | - | - |
| Plus et moins-values nettes de l'exercice | 12,585,055.34 | 7,510,451.50 |
| Acomptes versés sur plus et moins-values nettes de l'exercice | - | - |
| Total | 12,585,055.34 | 7,510,451.50 |
| Affectation | | |
| Distribution | - | - |
| Plus et moins-values nettes non distribuées | - | - |
| Capitalisation | 12,585,055.34 | 7,510,451.50 |
| Total | 12,585,055.34 | 7,510,451.50 |
| Information relative aux titres ouvrant droit à distribution | | |
| Nombre de titres | - | - |
| Distribution unitaire | - | - |

AXA INDICE EURO

Catégorie de classe D (Devise: EUR)

Tableau d'affectation des sommes distribuables afférentes au résultat

| | Exercice 30/09/2022 | Exercice 30/09/2021 |
|---|------------------------|------------------------|
| Sommes restant à affecter | | |
| Report à nouveau | 64.08 | 16.49 |
| Résultat | 3,244.32 | 2,092.27 |
| Total | 3,308.40 | 2,108.76 |
| Affectation | | |
| Distribution | 3,264.28 | 2,041.07 |
| Report à nouveau de l'exercice | 44.12 | 67.69 |
| Capitalisation | - | - |
| Total | 3,308.40 | 2,108.76 |
| Information relative aux titres ouvrant droit à distribution | | |
| Nombre de titres | 6,661.7884 | 7,038.1813 |
| Distribution unitaire | 0.49 | 0.29 |
| Crédits d'impôt et avoirs fiscaux attachés à la distribution du résultat | | |
| Montant global des crédits d'impôt et avoirs fiscaux: | | |
| provenant de l'exercice | - | - |
| provenant de l'exercice N-1 | - | - |
| provenant de l'exercice N-2 | - | - |
| provenant de l'exercice N-3 | - | - |
| provenant de l'exercice N-4 | - | - |

Tableau d'affectation des sommes distribuables afférentes aux plus et moins-values nettes

| | Exercice 30/09/2022 | Exercice 30/09/2021 |
|---|------------------------|------------------------|
| Sommes restant à affecter | | |
| Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées | - | - |
| Plus et moins-values nettes de l'exercice | 14,005.13 | 6,953.64 |
| Acomptes versés sur plus et moins-values nettes de l'exercice | - | - |
| Total | 14,005.13 | 6,953.64 |
| Affectation | | |
| Distribution | - | - |
| Plus et moins-values nettes non distribuées | - | - |
| Capitalisation | 14,005.13 | 6,953.64 |
| Total | 14,005.13 | 6,953.64 |
| Information relative aux titres ouvrant droit à distribution | | |
| Nombre de titres | - | - |
| Distribution unitaire | - | - |

AXA INDICE EURO

Tableau des résultats et autres éléments caractéristiques au cours des cinq derniers exercices

Catégorie de classe C (Devise: EUR)

| | 28/09/2018 | 30/09/2019 | 30/09/2020 | 30/09/2021 | 30/09/2022 |
|------------------------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------------------|
| Valeur liquidative (en EUR) | | | | | |
| Parts C | 34.43 | 37.01 | 33.63 | 43.21 | 36.15 |
| Actif net (en k EUR) | 220,407.73 | 226,588.56 | 182,137.55 | 209,852.64 | 137,287.02 |
| Nombre de titres | | | | | |
| Parts C | 6,401,412.1071 | 6,122,345.5704 | 5,415,199.4844 | 4,855,762.5942 | 3,796,767.7057 |

| Date de mise en paiement | 28/09/2018 | 30/09/2019 | 30/09/2020 | 30/09/2021 | 30/09/2022 |
|---|------------|------------|------------|------------|-------------|
| Distribution unitaire sur plus et moins-values nettes (y compris les acomptes) (en EUR) | - | - | - | - | - |
| Distribution unitaire sur résultat (y compris les acomptes) (en EUR) | - | - | - | - | - |
| Crédit d'impôt unitaire (*) personnes physiques (en EUR) | - | - | - | - | - |
| Capitalisation unitaire sur plus et moins-values nettes (en EUR) | | | | | |
| Parts C | 1.52 | 0.03 | -0.01 | 1.54 | 3.31 |
| Capitalisation unitaire sur résultat (en EUR) | | | | | |
| Parts C | 0.75 | 0.75 | 0.42 | 0.46 | 0.77 |

(*) "Le crédit d'impôt unitaire est déterminé à la date du paiement en application de l'instruction fiscale du 04/03/93 (Ints.4 K-1-93). Les montants théoriques, calculés selon les règles applicables aux personnes physiques, sont ici présentés à titre indicatif. "L'instruction 4 J-2-99 du 08/11/99 précise par ailleurs que les bénéficiaires d'avoir fiscal autres que les personnes physiques calculent sous leur responsabilité le montant des avoirs fiscaux auxquels ils ont droit."

AXA INDICE EURO

Catégorie de classe D (Devise: EUR)

| | 28/09/2018 | 30/09/2019 | 30/09/2020 | 30/09/2021 | 30/09/2022 |
|------------------------------------|--------------|-------------|-------------|------------|-------------------|
| Valeur liquidative (en EUR) | | | | | |
| Parts D | 23.05 | 24.28 | 21.61 | 27.45 | 22.73 |
| Actif net (en k EUR) | 3,925.84 | 261.45 | 221.26 | 193.26 | 151.48 |
| Nombre de titres | | | | | |
| Parts D | 170,315.9501 | 10,767.7544 | 10,236.8816 | 7,038.1813 | 6,661.7884 |

| Date de mise en paiement | 28/09/2018 | 30/09/2019 | 30/09/2020 | 30/09/2021 | 30/09/2022 |
|---|------------|------------|------------|------------|-------------|
| Distribution unitaire sur plus et moins-values nettes (y compris les acomptes) (en EUR) | - | - | 0.02 | - | - |
| Distribution unitaire sur résultat (y compris les acomptes) (en EUR) | 0.50 | 0.53 | 0.27 | 0.29 | 0.49 |
| Crédit d'impôt unitaire (*) personnes physiques (en EUR) | - | - | - | - | - |
| Capitalisation unitaire sur plus et moins-values nettes (en EUR) | | | | | |
| Parts D | 1.02 | 0.04 | - | 0.98 | 2.10 |
| Capitalisation unitaire sur résultat (en EUR) | | | | | |
| Parts D | - | - | - | - | - |

(*) "Le crédit d'impôt unitaire est déterminé à la date du paiement en application de l'instruction fiscale du 04/03/93 (Ints.4 K-1-93). Les montants théoriques, calculés selon les règles applicables aux personnes physiques, sont ici présentés à titre indicatif. "L'instruction 4 J-2-99 du 08/11/99 précise par ailleurs que les bénéficiaires d'avoir fiscal autres que les personnes physiques calculent sous leur responsabilité le montant des avoirs fiscaux auxquels ils ont droit."

AXA INDICE EURO

Inventaire des instruments financiers au 30 Septembre 2022

| Éléments d'actifs et libellé des valeurs | Quantité | Cours | Devise cotation | Valeur actuelle | % arrondi de l'actif net |
|---|------------|----------|-----------------|-----------------------|--------------------------|
| Actions et valeurs assimilées | | | | 132,028,216.66 | 96.06 |
| Négoциées sur un marché réglementé ou assimilé | | | | 132,028,216.66 | 96.06 |
| ADIDAS AG | 8,889.00 | 118.88 | EUR | 1,056,724.32 | 0.77 |
| ADYEN NV | 1,511.00 | 1,301.80 | EUR | 1,967,019.80 | 1.43 |
| AIRBUS SE | 30,872.00 | 88.89 | EUR | 2,744,212.08 | 2.00 |
| AIR LIQUIDE SA | 27,651.00 | 117.56 | EUR | 3,250,651.72 | 2.37 |
| ALLIANZ SE-REG | 21,584.00 | 161.80 | EUR | 3,492,291.20 | 2.54 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 47,127.00 | 46.74 | EUR | 2,202,951.62 | 1.60 |
| ASML HOLDING NV | 21,479.00 | 433.60 | EUR | 9,313,294.40 | 6.78 |
| AXA SA | 104,354.00 | 22.48 | EUR | 2,345,356.15 | 1.71 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 319,319.00 | 4.62 | EUR | 1,475,413.44 | 1.07 |
| BANCO SANTANDER SA | 887,424.00 | 2.40 | EUR | 2,127,599.04 | 1.55 |
| BASF SE | 48,533.00 | 39.60 | EUR | 1,921,906.80 | 1.40 |
| BAYER AG-REG | 51,912.00 | 47.41 | EUR | 2,461,407.48 | 1.79 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 16,936.00 | 69.99 | EUR | 1,185,350.64 | 0.86 |
| BNP PARIBAS | 60,123.00 | 43.60 | EUR | 2,621,663.42 | 1.91 |
| CRH PLC | 40,906.00 | 33.07 | EUR | 1,352,761.42 | 0.98 |
| DANONE | 33,785.00 | 48.57 | EUR | 1,640,937.45 | 1.19 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 10,040.00 | 168.25 | EUR | 1,689,230.00 | 1.23 |
| DEUTSCHE POST AG-REG | 52,064.00 | 31.11 | EUR | 1,619,971.36 | 1.18 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 183,282.00 | 17.49 | EUR | 3,205,968.74 | 2.33 |
| ENEL SPA | 410,484.00 | 4.22 | EUR | 1,733,884.42 | 1.26 |
| ENI SPA | 130,934.00 | 10.91 | EUR | 1,428,489.94 | 1.04 |
| ESSILORLUXOTTICA | 16,032.00 | 140.35 | EUR | 2,250,091.20 | 1.64 |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC-DI | 9,292.00 | 113.00 | EUR | 1,049,996.00 | 0.76 |
| HERMES INTERNATIONAL | 1,864.00 | 1,217.00 | EUR | 2,268,488.00 | 1.65 |
| IBERDROLA SA | 306,963.00 | 9.58 | EUR | 2,941,319.47 | 2.14 |
| INDUSTRIA DE DISEÑO TEXTIL | 58,727.00 | 21.28 | EUR | 1,249,710.56 | 0.91 |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 69,006.00 | 22.71 | EUR | 1,567,126.26 | 1.14 |
| ING GROEP NV | 199,063.00 | 8.86 | EUR | 1,763,300.05 | 1.28 |
| INTESA SANPAOLO | 975,725.00 | 1.70 | EUR | 1,661,464.53 | 1.21 |
| KERING | 3,844.00 | 458.55 | EUR | 1,762,666.20 | 1.28 |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE N | 52,483.00 | 26.14 | EUR | 1,371,643.21 | 1.00 |
| LINDE PLC | 26,264.00 | 279.20 | EUR | 7,332,908.80 | 5.34 |
| LOREAL | 12,862.00 | 330.25 | EUR | 4,247,675.50 | 3.09 |

AXA INDICE EURO

Inventaire des instruments financiers au 30 Septembre 2022

| Eléments d'actifs et libellé des valeurs | Quantité | Cours | Devise cotation | Valeur actuelle | % arrondi de l'actif net |
|--|------------|----------|-----------------|-----------------------|--------------------------|
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 13,791.00 | 610.40 | EUR | 8,418,026.40 | 6.12 |
| MERCEDES-BENZ GROUP AG | 41,556.00 | 52.35 | EUR | 2,175,456.60 | 1.58 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 7,403.00 | 247.50 | EUR | 1,832,242.50 | 1.33 |
| NOKIA OYJ | 285,100.00 | 4.42 | EUR | 1,260,284.55 | 0.92 |
| NORDEA BANK ABP | 197,387.00 | 8.80 | EUR | 1,737,005.60 | 1.26 |
| PERNOD RICARD SA | 10,635.00 | 188.85 | EUR | 2,008,419.75 | 1.46 |
| PROSUS NV | 45,615.00 | 53.97 | EUR | 2,461,841.55 | 1.79 |
| SAFRAN SA | 20,041.00 | 94.01 | EUR | 1,884,054.41 | 1.37 |
| SANOFI | 60,726.00 | 78.40 | EUR | 4,760,918.40 | 3.46 |
| SAP SE | 57,327.00 | 84.12 | EUR | 4,822,347.24 | 3.51 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 30,177.00 | 116.94 | EUR | 3,528,898.38 | 2.57 |
| SIEMENS AG-REG | 39,345.00 | 101.20 | EUR | 3,981,714.00 | 2.90 |
| STELLANTIS NV | 119,860.00 | 12.27 | EUR | 1,470,921.92 | 1.07 |
| TOTALENERGIES SE | 138,397.00 | 48.27 | EUR | 6,681,115.18 | 4.86 |
| VINCI SA | 29,849.00 | 83.17 | EUR | 2,482,541.33 | 1.81 |
| VOLKSWAGEN AG-PREF | 10,895.00 | 126.40 | EUR | 1,377,128.00 | 1.00 |
| VONOVIA SE | 37,903.00 | 22.21 | EUR | 841,825.63 | 0.61 |
| Titres d'OPC | | | | 4,230,464.86 | 3.08 |
| OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'Union européenne | | | | 4,230,464.86 | 3.08 |
| AXA COURT TERME C 2DEC | 1,791.16 | 2,361.86 | EUR | 4,230,464.86 | 3.08 |
| Instruments financiers à terme | | | | - | - |
| Futures | | | | -514,425.00 | -0.37 |
| EURO STOXX 50 - FUTURE 16/12/2022 | 155.00 | 3,315.00 | EUR | -514,425.00 | -0.37 |
| Appels de marge | | | | 514,425.00 | 0.37 |
| Créances | | | | 638,306.61 | 0.46 |
| Dettes | | | | -165,508.32 | -0.12 |
| Dépôts | | | | - | - |
| Autres comptes financiers | | | | 707,019.80 | 0.51 |
| TOTAL ACTIF NET | | | EUR | 137,438,499.61 | 100.00 |