

FCP de droit français

CYRIL SYSTEMATIC

RAPPORT SEMESTRIEL

au 30 juin 2026

Société de Gestion : FINALTIS
Dépositaire : Caceis Bank
Commissaire aux Comptes : Deloitte & Associés

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique (*)
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier	2 346 951,51
b) Avoirs bancaires	441 017,27
c) Autres actifs détenus par l'OPC	754 645,74
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	3 542 614,52
e) Passif	-323 278,27
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	3 219 336,25

(*) Les montants sont signés

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

Part	Type de part	Actif net de la part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
CYRIL SYSTEMATIC C en USD	C	3 365 751,92	108,9400	30 895,46
CYRIL SYSTEMATIC I en EUR	C	50 775,76	2,1774	23 319,44
CYRIL SYSTEMATIC P en EUR	C	221 833,19	303,4142	731,12

ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Éléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
A) Les titres financiers éligibles et les 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. Et B) Les titres financiers éligibles et les 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.	72,90	66,25
C) Les titres financiers éligibles et les 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.		
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	8,56	7,78

(*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(**) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
Euro	EUR	2 346 951,51	72,90	66,25
TOTAL		2 346 951,51	72,90	66,25

(*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(**) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

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

Pays	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
FRANCE	72,90	66,25
TOTAL	72,90	66,25

(*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(**) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

RÉPARTITION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE

Nature d'actifs	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	8,56	7,78
Autres OPC et fonds d'investissements		
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne		
Autres		
TOTAL	8,56	7,78

(*) Se reporter au f) de l'état du patrimoine

(**) Se reporter au d) de l'état du patrimoine

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
A) Les titres financiers éligibles et les 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.	1 869 513,02	730 000,00
Et B) Les titres financiers éligibles et les 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.		
C) Les titres financiers éligibles et les 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.		
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	97 535,58	

INFORMATIONS DIVERSES

Etablissement dépositaire : *Caceis Bank - 89-91 rue Gabriel Péri - 92120 - Montrouge*

Le relevé Périodicité Semestrielle détaillé de l'actif est disponible dans un délai de huit semaines à compter de la fin de la période. Il peut être transmis sur simple demande auprès de la société de gestion :

FINALTIS - 63, avenue des Champs-Élysées - 75008 – Paris

INFORMATION SUR LES FRAIS DE GESTION VARIABLES

	30/06/2026
Part CYRIL SYSTEMATIC C	
Frais de gestion variables provisionnés	16 589,64
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,69
Frais de gestion variables acquis	36,51
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Part CYRIL SYSTEMATIC I	
Frais de gestion variables provisionnés	
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Part CYRIL SYSTEMATIC P	
Frais de gestion variables provisionnés	
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00

« Le montant des frais de gestion variables affiché ci-dessus correspond à la somme des provisions et reprises de provisions ayant impacté l'actif net au cours de la période sous revue. »

TRANSPARENCE DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA RÉUTILISATION DES INSTRUMENTS FINANCIERS - RÈGLEMENT SFTR - en devise de comptabilité de l'OPC (EUR)

Au cours de l'exercice, l'OPC n'a pas fait l'objet d'opérations relevant de la réglementation SFTR.

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TITRES DE CRÉANCES			2 346 951,51	72,90
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			2 346 951,51	72,90
Services aux collectivités			2 346 951,51	72,90
FRAN TREA BILL BTF ZCP 30-12-26	EUR	300 000	296 307,43	9,20
FRENCH REPUBLIC ZCP 02-12-26	EUR	100 000	98 970,36	3,07
FRENCH REPUBLIC ZCP 04-11-26	EUR	120 000	118 997,92	3,70
FRENCH REPUBLIC ZCP 09-09-26	EUR	190 000	189 135,41	5,87
FRENCH REPUBLIC ZCP 12-08-26	EUR	100 000	99 741,85	3,10
FRENCH REPUBLIC ZCP 15-07-26	EUR	150 000	149 873,87	4,66
FRENCH REPUBLIC ZCP 16-06-27	EUR	200 000	195 122,74	6,06
FRENCH REPUBLIC ZCP 18-11-26	EUR	80 000	79 250,16	2,46
FRENCH REPUBLIC ZCP 20-05-27	EUR	220 000	215 077,28	6,68
FRENCH REPUBLIC ZCP 21-04-27	EUR	230 000	225 342,21	7,00
FRENCH REPUBLIC ZCP 21-10-26	EUR	80 000	79 410,04	2,47
FRENCH REPUBLIC ZCP 24-02-27	EUR	170 000	167 243,58	5,19
FRENCH REPUBLIC ZCP 24-03-27	EUR	320 000	314 182,42	9,77
FRENCH REPUBLIC ZCP 27-01-27	EUR	120 000	118 296,24	3,67
TITRES D'OPC			275 577,11	8,56
OPCVM			275 577,11	8,56
Gestion collective			275 577,11	8,56
AMUNDI EURO LIQUIDITY-RATED RESPONSIBLE PART E	EUR	25,25	275 577,11	8,56
Total			2 622 528,62	81,46

(*) Le secteur d'activité représente l'activité principale de l'émetteur de l'instrument financier ; il est issu de sources fiables reconnues au plan international (GICS et NACE principalement).

Inventaire des opérations à terme de devises

Type d'opération	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)			
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)	
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)
Total						

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions exprimé dans la devise de comptabilisation.

Inventaire des instruments financiers à terme

Inventaire des instruments financiers à terme - actions

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
E-MIN RUS 200 0926	5	22 270,62		666 608,30
EURO STOXX 50 0926	6	270,00		381 360,00
HANG SENG FUT 0726	3	3 918,11		382 551,57
ICF MSCI BRAZ 0926	6	4 517,60		386 937,49
MSCI India Ne 0926	6		-4 920,33	614 866,05
OSE TOPIX FUT 0926	1	3 904,57		215 585,95
SP 500 MINI 0926	1	2 403,26		330 425,93
Sous-total 1.		37 284,16	-4 920,33	2 978 335,29
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total		37 284,16	-4 920,33	2 978 335,29

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

Inventaire des instruments financiers à terme - taux d'intérêts

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
EURO SCHATZ 0926	2		-10,00	211 920,00
LONG GILT FUT 0926	-2		-2 298,74	-207 142,36
TU CBOT UST 2 0926	-23	6 518,41		-4 150 809,56
US 10YR NOTE 0926	-6		-1 395,33	-577 257,70
Sous-total 1.		6 518,41	-3 704,07	-4 723 289,62
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total		6 518,41	-3 704,07	-4 723 289,62

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

Inventaire des instruments financiers à terme - de change

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
BP GBPUSD 0926	-12		-1 049,24	-8 703,60
CME BRL/USD 0826	-24		-210,12	-403 431,97
CME CHF/USD 0926	-5	8 946,55		-682 646,43
CME JPY/USD 0926	-15	14 099,98		-1 015 638,68
EC EURUSD 0926	-8	7 605,94		-1 003 020,49
IU INRUSD 0726	-31	1 465,59		-571 689,72
Sous-total 1.		32 118,06	-1 259,36	-3 685 130,89
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total		32 118,06	-1 259,36	-3 685 130,89

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

Inventaire des instruments financiers à terme - sur risque de crédit

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.				
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total				

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

Inventaire des instruments financiers à terme - autres expositions

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.				
2. Options				
Sous-total 2.				
3. Swaps				
Sous-total 3.				
4. Autres instruments				
Sous-total 4.				
Total				

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

Inventaire des instruments financiers à terme ou des opérations à terme de devises utilisés en couverture d'une catégorie de part

Type d'opération	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 (*)	
ECHEANCE 31/07		-1 394,09	USD	2 889 161,27	EUR	-2 890 555,36	FR0011073766
Total		-1 394,09		2 889 161,27		-2 890 555,36	

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions exprimé dans la devise de comptabilisation.

Synthèse de l'inventaire

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	2 622 528,62
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	
Total instruments financiers à terme - actions	32 363,83
Total instruments financiers à terme - taux	2 814,34
Total instruments financiers à terme - change	30 858,70
Total instruments financiers à terme - crédit	
Total instruments financiers à terme - autres expositions	
Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises	-1 394,09
Autres actifs (+)	844 165,27
Autres passifs (-)	-312 000,42
Passifs de financement (-)	
Total = actif net	3 219 336,25

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part CYRIL SYSTEMATIC C	USD	108,9400	30 895,46
Part CYRIL SYSTEMATIC I	EUR	2,1774	23 319,44
Part CYRIL SYSTEMATIC P	EUR	303,4142	731,12