

PROSPER FUNDS SICAV

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

Rapport annuel révisé au 31/12/25

R.C.S. Luxembourg B 150.045

PROSPER FUNDS SICAV

Table des Matières

Organisation et administration	3
Rapport du Conseil d'Administration	5
Rapport d'audit	6
Etat des actifs nets au 31/12/25	10
Etat des opérations et des variations des actifs nets du 01/01/25 au 31/12/25	12
Statistiques	14
Changement dans le nombre d'actions en circulation du 01/01/25 au 31/12/25	17
Portefeuille-titres au 31/12/25	19
PROSPER STARS & STRIPES FUND	19
GLOBAL MACRO FUND	21
PLURIMI WORLD EQUITY	24
PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY (lancé le 10/01/25)	25
Notes aux états financiers - Etat des instruments dérivés	27
Autres notes aux états financiers	33
Informations supplémentaires non auditées	41

Les souscriptions ne peuvent être effectuées que sur base du prospectus comprenant les fiches signalétiques de chacun des compartiments et sur base des informations clés pour l'investisseur ("Informations Clés"). Le prospectus ne peut être distribué qu'accompagné du dernier rapport annuel et du dernier rapport semestriel, si celui-ci est plus récent que le rapport annuel.

PROSPER FUNDS SICAV

Organisation et administration

Siège Social :

12, rue Eugène Ruppert
L-2453 Luxembourg

Date de constitution :

11 décembre 2009

Conseil d'Administration du Fonds :

Président :

- Sophie MOSNIER, Administrateur indépendant

Membres :

- Antonio TRICARICO, Attaché de Direction (jusqu'au 21 novembre 2025)
CA Indosuez Fund Solutions S.A.*
- Thierry ROBIN, Administrateur
Prosper Professional Services S.A.
- Vincent PETIT-JEAN, Administrateur indépendant (depuis le 30 avril 2025)

Société de Gestion :

CA Indosuez Fund Solutions S.A.*
12, rue Eugène Ruppert,
L-2453 Luxembourg

Gestionnaires :

Roubaix Capital LLC
155 S. Madison St., Suite 330
CO 80209 Denver, USA
(pour le compartiment Prosper Stars & Stripes Fund)

Plurimi Wealth LLP
30, St. James's Square,
UK-SW1Y 4AL London
(pour les compartiments Global Macro Fund, Plurimi World Equity et Plurimi World Long Short Equity)

Gestionnaire du Risque de Change :

CA Indosuez Fund Solutions S.A.*
12, rue Eugène Ruppert
L-2453 Luxembourg
(pour le compartiment Prosper Stars & Stripes Fund)

Plurimi Wealth LLP
30, St. James's Square
UK-SW1Y 4AL London
(pour les compartiments Global Macro Fund, Plurimi World Equity et Plurimi World Long Short Equity)

Distributeur Global :

Prosper Professional Services S.A., Genève
8, Rue Muzy
CH-1207 Genève

Banque Dépositaire et Agent Payeur :

Banque Degroof Petercam Luxembourg S.A. (jusqu'au 10 avril 2025)
12, rue Eugène Ruppert
L-2453 Luxembourg

Caceis Bank, Luxembourg Branch (depuis le 11 avril 2025)
5 Allée Scheffer
L-2520 Luxembourg

Agent Domiciliaire et Administrateur d'OPC :

CA Indosuez Fund Solutions S.A.*
12, rue Eugène Ruppert
L-2453 Luxembourg

PROSPER FUNDS SICAV

Organisation et administration

Réviseur d'Entreprises agréé :

PricewaterhouseCoopers Assurance, Société coopérative (depuis le 01/07/2025)

PricewaterhouseCoopers, Société coopérative (jusqu'au 30/06/2025)

2, rue Gerhard Mercator

B.P. 1443,

L-1014 Luxembourg

*Dans le cadre de l'acquisition de Degroof Petercam par CA Indosuez Wealth Management, une filiale de Crédit Agricole S.A., une série de restructurations a été mise en œuvre au sein du groupe, y compris la fusion de la Société de Gestion CA Indosuez Wealth (Asset Management), avec Degroof Petercam Asset Services S.A. le 1er juin 2025.

La fusion a été structurée de manière à ce que Degroof Petercam Asset Services S.A. absorbe CA Indosuez Wealth Asset Management) et, en même temps, change de nom pour devenir CA Indosuez Fund Solutions S.A..

PROSPER FUNDS SICAV

Rapport du Conseil d'Administration

L'année 2025 s'est inscrite dans la continuité d'un environnement économique et géopolitique complexe, marqué par des ajustements progressifs des politiques monétaires et par des dynamiques économiques différenciées selon les régions. Durant cette période prolongée d'incertitudes, les marchés ont évolué très favorablement malgré une visibilité limitée.

La très bonne tenue de nombreux marchés financiers a masqué une croissance mondiale hétérogène. L'économie américaine a continué d'afficher une certaine résilience, tandis que l'Europe a connu une croissance modérée, pénalisée par des facteurs structurels persistants. En Asie, l'activité économique est restée contrastée, reflétant des situations économiques et des orientations de politiques économiques hétérogènes au sein de la région. L'évolution de l'inflation et des conditions financières a conduit les principales banques centrales à maintenir une approche prudente, toutefois marquée par une baisse des taux de la part de plusieurs d'entre elles.

Dans cet environnement, le compartiment Prosper Global Macro Fund a enregistré en 2025 une performance de +3,3 % (Classe Global Macro Fund I EUR), tout en maintenant une volatilité maîtrisée. Les actifs sous gestion ont progressé de 14 % sur l'année, passant de EUR 90,1 millions à EUR 105,0 millions à fin 2025. La stratégie non directionnelle et décorrélée, caractérisée par une gestion rigoureuse des risques, a permis au fonds de poursuivre son développement dans un environnement de marché complexe.

Le compartiment Prosper Stars & Stripes Fund a, quant à lui, réalisé une performance de +9,2 % (Classe Prosper Stars & Stripes Fund I USD) en 2025. Le fonds a continué de se distinguer par une approche fondée sur une sélection rigoureuse de titres et un contrôle attentif des risques. Les actifs sous gestion ont progressé de 19 %, atteignant USD 145,8 millions à la fin de l'année.

Le compartiment Plurimi World Equity Fund a enregistré en 2025 une performance de +21,4 % (Classe Plurimi World Equity Fund S USD). Les actifs sous gestion ont connu une forte croissance de 65 % sur l'exercice, passant de USD 58,8 millions à USD 167,3 millions à fin 2025.

Enfin, le compartiment Plurimi World Long Short Equity Fund, lancé le 10 janvier 2025, a réalisé une performance de +11,1 % (Classe Plurimi World Long Short Equity Fund I USD) depuis son lancement. À fin 2025, les actifs sous gestion s'élevaient à USD 130,8 millions.

L'année 2025 confirme la pertinence des stratégies d'investissement alternatives proposées par la SICAV. Ces stratégies de gestion active, non indicielle, à objectif de performance absolue qu'offre la SICAV Prosper continuent de constituer des solutions de diversification adaptées aux attentes des investisseurs dans des environnements de marché complexes offrant peu de visibilité. Nous restons confiants dans la capacité des gérants des fonds à créer durablement cette valeur ajoutée pour les investisseurs, grâce à leur engagement et leur alignement d'intérêt.

Luxembourg, 10 Février 2026

Rapport d'audit

Aux Actionnaires de

PROSPER FUNDS SICAV

Notre opinion

A notre avis, les états financiers ci-joints donnent une image fidèle de la situation financière de PROSPER FUNDS SICAV (le « Fonds ») et de chacun de ses compartiments au 31 décembre 2025, ainsi que du résultat de leurs opérations et des changements des actifs nets pour l'exercice clos à cette date, conformément aux obligations légales et réglementaires relatives à l'établissement et à la présentation des états financiers en vigueur au Luxembourg.

Ce que nous avons audité

Les états financiers du Fonds comprennent :

- l'état des actifs nets au 31 décembre 2025 ;
- l'état des opérations et des variations des actifs nets pour l'exercice clos à cette date ; et
- les notes aux états financiers, incluant un résumé des principales méthodes comptables.

Fondement de l'opinion

Nous avons effectué notre audit en conformité avec la Loi du 23 juillet 2016 relative à la profession de l'audit (la Loi du 23 juillet 2016) et les normes internationales d'audit (ISA) telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la Commission de Surveillance du Secteur Financier (CSSF). Les responsabilités qui nous incombent en vertu de la Loi du 23 juillet 2016 et des normes ISA telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF sont plus amplement décrites dans la section « Responsabilités du Réviseur d'entreprises agréé pour l'audit des états financiers » du présent rapport.

Nous estimons que les éléments probants que nous avons recueillis sont suffisants et appropriés pour fonder notre opinion d'audit.

PricewaterhouseCoopers Assurance, Société coopérative,
2 rue Gerhard Mercator, L-2182 Luxembourg
T : +352 494848 1, F : +352 494848 2900, www.pwc.lu

Nous sommes indépendants du Fonds conformément au code international de déontologie des professionnels comptables, y compris les normes internationales d'indépendance, publié par le Comité des normes internationales d'éthique pour les comptables (le Code de l'IESBA) tel qu'adopté pour le Luxembourg par la CSSF ainsi qu'aux règles de déontologie qui s'appliquent à l'audit des états financiers et nous nous sommes acquittés des autres responsabilités éthiques qui nous incombent selon ces règles.

Autres informations

La responsabilité des autres informations incombe au Conseil d'Administration du Fonds. Les autres informations se composent des informations présentées dans le rapport annuel mais ne comprennent pas les états financiers et notre rapport d'audit sur ces états financiers.

Notre opinion sur les états financiers ne s'étend pas aux autres informations et nous n'exprimons aucune forme d'assurance sur ces informations.

En ce qui concerne notre audit des états financiers, notre responsabilité consiste à lire les autres informations et, ce faisant, à apprécier s'il existe une incohérence significative entre celles-ci et les états financiers ou la connaissance que nous avons acquise au cours de l'audit, ou encore si les autres informations semblent autrement comporter une anomalie significative. Si, à la lumière des travaux que nous avons effectués, nous concluons à la présence d'une anomalie significative dans les autres informations, nous sommes tenus de signaler ce fait. Nous n'avons rien à signaler à cet égard.

Responsabilités du Conseil d'Administration du Fonds pour les états financiers

Le Conseil d'Administration du Fonds est responsable de l'établissement et de la présentation fidèle des états financiers conformément aux obligations légales et réglementaires relatives à l'établissement et à la présentation des états financiers en vigueur au Luxembourg, ainsi que du contrôle interne qu'il considère comme nécessaire pour permettre l'établissement d'états financiers ne comportant pas d'anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs.

Lors de l'établissement des états financiers, c'est au Conseil d'Administration du Fonds qu'il incombe d'évaluer la capacité du Fonds et de ses compartiments à poursuivre leur exploitation, de communiquer, le cas échéant, les questions relatives à la continuité d'exploitation et d'appliquer le principe comptable de continuité d'exploitation, sauf si le Conseil d'Administration du Fonds a l'intention de liquider le Fonds ou certains de ses compartiments ou de cesser leur activité ou si aucune autre solution réaliste ne s'offre à lui.

Responsabilités du Réviseur d'entreprises agréé pour l'audit des états financiers

Les objectifs de notre audit sont d'obtenir l'assurance raisonnable que les états financiers pris dans leur ensemble ne comportent pas d'anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs, et de délivrer un rapport d'audit contenant notre opinion. L'assurance raisonnable correspond à un niveau élevé d'assurance, qui ne garantit toutefois pas qu'un audit réalisé conformément à la Loi du 23 juillet 2016 et aux ISA telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF permettra toujours de détecter toute anomalie significative qui pourrait exister. Les anomalies peuvent provenir de fraudes ou résulter d'erreurs et elles sont considérées comme significatives lorsqu'il est raisonnable de s'attendre à ce que, individuellement ou collectivement, elles puissent influencer sur les décisions économiques que les utilisateurs des états financiers prennent en se fondant sur ceux-ci.

Dans le cadre d'un audit réalisé conformément à la Loi du 23 juillet 2016 et aux ISA telles qu'adoptées pour le Luxembourg par la CSSF, nous exerçons notre jugement professionnel et faisons preuve d'esprit critique tout au long de cet audit. En outre :

- nous identifions et évaluons les risques que les états financiers comportent des anomalies significatives, que celles-ci proviennent de fraudes ou résultent d'erreurs, concevons et mettons en œuvre des procédures d'audit en réponse à ces risques, et réunissons des éléments probants suffisants et appropriés pour fonder notre opinion. Le risque de non-détection d'une anomalie significative résultant 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 ;
- nous acquérons une compréhension des éléments du contrôle interne pertinents pour l'audit afin de concevoir des procédures d'audit appropriées aux circonstances et non dans le but d'exprimer une opinion sur l'efficacité du contrôle interne du Fonds ;

- nous apprécions le caractère approprié des méthodes comptables retenues et le caractère raisonnable des estimations comptables faites par le Conseil d'Administration du Fonds, de même que les informations y afférentes fournies par ce dernier ;
- nous tirons une conclusion quant au caractère approprié de l'utilisation par le Conseil d'Administration du Fonds du principe comptable de continuité d'exploitation et, selon les éléments probants obtenus, quant à l'existence ou non d'une incertitude significative liée à des événements ou situations susceptibles de jeter un doute important sur la capacité du Fonds ou de ses compartiments à poursuivre leur exploitation. Si nous concluons à l'existence d'une incertitude significative, nous sommes tenus d'attirer l'attention des lecteurs de notre rapport sur les informations fournies dans les états financiers au sujet de cette incertitude ou, si ces informations ne sont pas adéquates, d'exprimer une opinion modifiée. Nos conclusions s'appuient sur les éléments probants obtenus jusqu'à la date de notre rapport. Cependant, des événements ou situations futurs pourraient amener le Fonds ou ses compartiments à cesser leur exploitation ;
- nous évaluons la présentation d'ensemble, la forme et le contenu des états financiers, y compris les informations fournies dans les notes, et apprécions si les états financiers représentent les opérations et événements sous-jacents d'une manière propre à donner une image fidèle.

Nous communiquons aux responsables du gouvernement d'entreprise notamment l'étendue et le calendrier prévu des travaux d'audit et nos constatations importantes, y compris toute déficience importante du contrôle interne que nous aurions relevée au cours de notre audit.

Luxembourg, 2 avril 2026

PricewaterhouseCoopers Assurance, Société coopérative

Représentée par

Signed by:

4B89FB7F1D59424...

Antoine Geoffroy

PROSPER FUNDS SICAV

Etat des actifs nets au 31/12/25

	Note	PROSPER STARS & STRIPEES FUND	GLOBAL MACRO FUND	PLURIMI WORLD EQUITY	PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY (lancé le 10/01/25)
		31/12/25 USD	31/12/25 EUR	31/12/25 USD	31/12/25 USD
Actifs		153.048.325,11	107.013.911,32	167.972.143,18	138.795.945,98
Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation	2.2	138.466.967,52	94.556.554,33	167.120.660,64	116.849.875,15
<i>Prix de revient</i>		128.796.680,63	89.811.951,81	143.589.178,86	105.230.447,63
Avoirs en banque et liquidités		12.805.797,47	10.253.229,87	815.957,89	20.638.940,56
Collatéral à recevoir		1.302.661,65	649.998,79	-	692.925,50
A recevoir sur investissements vendus		62.737,52	-	-	-
A recevoir sur souscriptions		397.273,94	-	-	4.032,43
Plus-value nette non réalisée sur contrats de change à terme		-	163.420,39	-	179.775,42
Plus-value nette non réalisée sur contrats futures		-	663.341,21	-	-
Dividendes à recevoir sur portefeuille-titres		7.241,47	8.649,01	35.524,65	13.360,55
Intérêts à recevoir sur portefeuille-titres		-	718.700,55	-	411.975,67
Autres intérêts à recevoir		5.645,54	10,69	-	5.060,70
A recevoir sur change, net		-	6,48	-	-
Passifs		7.281.361,60	2.036.491,09	643.943,79	7.954.896,89
Découvert bancaire		3.274,04	664.434,25	2.934,19	5.992.741,03
Collatéral à payer		1.889,19	650.000,00	-	704.591,63
A payer sur investissements achetés		4.682.450,80	-	152.463,34	-
A payer sur rachats		37.968,00	-	-	-
A payer sur CFDs		-	-	-	215.600,12
Moins-value nette non réalisée sur contrats de change à terme		107.203,58	-	-	-
Moins-value nette non réalisée sur CFDs		539.864,27	-	-	-
Commissions de gestion à payer	3	68.304,78	44.816,17	42.177,00	48.556,59
Commissions de la Société de Gestion		582.924,73	347.286,83	326.816,50	468.472,77
Commissions de dépositaire et de sous-dépositaire à payer	5	45.739,06	29.618,04	53.085,12	35.233,23
Commissions d'administration à payer		15.925,06	12.684,51	16.879,42	14.993,01
Frais de domiciliation à payer		5.354,93	3.888,66	3.388,17	1.451,49
Commissions de l'agent de transfert à payer		1.632,43	13.991,63	760,86	131,51
Commissions de performance à payer	4	1.062.292,22	223.120,90	-	304.721,14
Frais d'audit à payer		1.948,00	1.611,21	2.725,75	1.920,28
Taxe d'abonnement à payer	9	9.359,95	6.655,08	31.686,24	14.881,31
Rémunération administrateurs à payer		-	1.241,49	4.995,33	2.337,36
Dividendes à payer sur CFDs		44.830,96	-	-	122.642,25
Autres intérêts à payer		-	-	-	14.423,63
Autres passifs		70.399,60	37.142,32	6.031,87	12.199,54
Valeur nette d'inventaire		145.766.963,51	104.977.420,23	167.328.199,39	130.841.049,09

PROSPER FUNDS SICAV

Etat des actifs nets au 31/12/25

	Note	Combiné
		31/12/25
		EUR
Actifs		498.530.292,85
Portefeuille-titres à la valeur d'évaluation	2.2	454.246.199,11
<i>Prix de revient</i>		<i>411.338.033,91</i>
Avoirs en banque et liquidités		39.424.923,79
Collatéral à recevoir		2.349.166,19
A recevoir sur investissements vendus		53.418,64
A recevoir sur souscriptions		341.697,28
Plus-value nette non réalisée sur contrats de change à terme		316.492,40
Plus-value nette non réalisée sur contrats futures		663.341,21
Dividendes à recevoir sur portefeuille-titres		56.438,76
Intérêts à recevoir sur portefeuille-titres		1.069.482,34
Autres intérêts à recevoir		9.126,65
A recevoir sur change, net		6,48
Passifs		15.557.886,01
Découvert bancaire		5.772.313,90
Collatéral à payer		1.251.541,84
A payer sur investissements achetés		4.116.747,53
A payer sur rachats		32.328,32
A payer sur CFDs		183.575,39
Moins-value nette non réalisée sur contrats de change à terme		91.279,82
Moins-value nette non réalisée sur CFDs		459.674,12
Commissions de gestion à payer	3	180.231,36
Commissions de la Société de Gestion		1.520.784,21
Commissions de dépositaire et de sous-dépositaire à payer	5	143.762,88
Commissions d'administration à payer		53.382,27
Frais de domiciliation à payer		12.568,97
Commissions de l'agent de transfert à payer		16.141,40
Commissions de performance à payer	4	1.387.081,36
Frais d'audit à payer		7.225,78
Taxe d'abonnement à payer	9	54.275,25
Rémunération administrateurs à payer		7.485,00
Dividendes à payer sur CFDs		142.597,14
Autres intérêts à payer		12.281,18
Autres passifs		112.608,29
Valeur nette d'inventaire		482.972.406,84

PROSPER FUNDS SICAV

Etat des opérations et des variations des actifs nets du 01/01/25 au 31/12/25

	Note	PROSPER STARS & STRIPES FUND	GLOBAL MACRO FUND	PLURIMI WORLD EQUITY	PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY (lancé le 10/01/25)
		31/12/25 USD	31/12/25 EUR	31/12/25 USD	31/12/25 USD
Revenus		2.825.025,65	2.143.621,60	1.409.785,38	2.240.916,74
Dividendes sur portefeuille-titres, nets		303.747,41	501.316,56	1.384.052,80	632.018,85
Dividendes reçus sur CFDs		-	-	-	214.437,18
Intérêts reçus sur obligations, nets		-	1.520.307,29	-	908.332,20
Intérêts reçus sur CFDs		745.539,51	-	-	122.358,79
Intérêts bancaires		1.775.737,81	121.978,54	20.233,24	359.088,62
Autres revenus		0,92	19,21	5.499,34	4.681,10
Dépenses		5.934.243,69	2.391.760,63	1.651.923,48	3.668.399,90
Commissions de gestion et de la Société de Gestion	3	2.287.706,54	1.464.680,24	1.148.410,37	1.580.771,16
Commissions de performance	4	1.871.644,78	553.572,46	-	362.748,05
Commissions de dépositaire	5	132.558,97	90.416,08	119.983,66	86.967,50
Commissions d'administration		100.014,51	81.339,43	66.689,88	68.117,14
Frais de domiciliation	6	3.589,21	2.674,49	3.268,46	1.441,03
Frais d'audit		14.274,55	10.601,36	13.262,92	10.345,45
Frais légaux		346,97	2.289,62	2.629,81	2.612,91
Frais de transaction	8	600.323,85	56.560,08	168.613,35	144.864,19
Rémunération administrateurs		19.085,21	10.878,63	18.993,21	13.273,88
Taxe d'abonnement	9	34.331,22	23.456,61	74.885,17	49.132,46
Intérêts payés sur découvert bancaire		22.148,12	23.226,84	6.064,34	88.072,18
Dividendes payés sur CFDs		772.708,87	-	-	949.027,78
Intérêts payés sur CFDs		-	-	-	264.360,87
Frais bancaires		-	-	-	-
Autres dépenses		75.510,89	72.064,79	29.122,31	46.914,71
Revenus / (Pertes) net(te)s des investissements		-3.109.218,04	-248.139,03	-242.138,10	-1.427.483,16
Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s sur :					
- ventes d'investissements	2.2.2.3	17.913.576,25	-605.960,92	775.032,30	1.035.074,80
- options		-	1.174.020,61	-	616.991,96
- contrats de change à terme		4.510.211,32	-5.540.060,53	-	3.527.681,94
- contrats futures		-	771.481,56	279.957,04	73.480,00
- CFDs		227.217,20	-	-	-1.309.655,71
- change	2.5	-546.671,90	-809.445,24	340.366,09	516.398,17
Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s		18.995.114,83	-5.258.103,55	1.153.217,33	3.032.488,00
Variation de la plus-value / (moins-value) nette non réalisée sur :					
- ventes d'investissements	2.2	-1.776.376,78	2.022.427,92	25.817.072,25	11.619.427,52
- options		-	-7.880,16	-	-
- contrats de change à terme		802.523,12	-76.708,21	-	179.775,42
- contrats futures		-	201.951,51	-	-
- CFDs		-3.295.072,89	-	-	-
Augmentation / (diminution) nette des actifs nets provenant des opérations		14.726.188,28	-3.118.312,49	26.970.289,58	14.831.690,94
Souscriptions d'actions		46.160.893,24	38.938.576,71	101.662.445,22	127.811.218,76
Rachats d'actions		-33.023.579,24	-20.978.445,52	-20.109.660,56	-11.801.860,61
Augmentation / (diminution) nette des actifs		27.863.502,28	14.841.818,70	108.523.074,24	130.841.049,09
Actifs nets au début de l'exercice		117.903.461,23	90.135.601,53	58.805.125,15	-
Actifs nets à la fin de l'exercice		145.766.963,51	104.977.420,23	167.328.199,39	130.841.049,09

PROSPER FUNDS SICAV

Etat des opérations et des variations des actifs nets du 01/01/25 au 31/12/25

	Note	Combiné
		31/12/25
		EUR
Revenus		7.657.460,20
Dividendes sur portefeuille-titres, nets		2.476.555,23
Dividendes reçus sur CFDs		182.585,19
Intérêts reçus sur obligations, nets		2.293.717,99
Intérêts reçus sur CFDs		738.982,76
Intérêts bancaires		1.956.930,78
Autres revenus		8.688,25
Dépenses		11.974.601,15
Commissions de gestion et de la Société de Gestion	3	5.736.371,72
Commissions de performance	4	2.456.073,91
Commissions de dépositaire	5	379.496,19
Commissions d'administration		281.281,12
Frais de domiciliation	6	9.740,52
Frais d'audit		42.857,24
Frais légaux		7.049,02
Frais de transaction	8	834.627,60
Rémunération administrateurs		54.603,18
Taxe d'abonnement	9	158.284,70
Intérêts payés sur découvert bancaire		122.238,84
Dividendes payés sur CFDs		1.465.994,00
Intérêts payés sur CFDs		225.093,34
Frais bancaires		
Autres dépenses		201.102,13
Revenus / (Pertes) net(te)s des investissements		-4.317.140,95
Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s sur :		
- ventes d'investissements	2.2,2,3	16.188.013,58
- options		1.699.366,06
- contrats de change à terme		1.303.903,24
- contrats futures		1.072.419,91
- CFDs		-921.655,68
- change	2.5	-545.413,26
Bénéfices / (Pertes) net(te)s réalisé(e)s		14.479.492,90
Variation de la plus-value / (moins-value) nette non réalisée sur :		
- ventes d'investissements	2.2	32.385.681,35
- options		-7.880,16
- contrats de change à terme		759.682,05
- contrats futures		201.951,51
- CFDs		-2.805.630,63
Augmentation / (diminution) nette des actifs nets provenant des opérations		45.013.297,02
Souscriptions d'actions		273.631.034,65
Rachats d'actions		-76.268.241,10
Augmentation / (diminution) nette des actifs		242.376.090,57
Réévaluation de la balance d'ouverture		-20.189.779,19
Actifs nets au début de l'exercice		260.786.095,38
Actifs nets à la fin de l'exercice		482.972.406,84

PROSPER FUNDS SICAV

Statistiques

PROSPER STARS & STRIPES FUND

		31/12/25	31/12/24	31/12/23
Actifs Nets Totaux	USD	145.766.963,51	117.903.461,23	68.120.136,94
13				
Nombre d'actions		10.000.000,000	10.000.000,000	10.000.000,000
VNI par action	USD	0,02	0,02	0,02
I CHF				
Nombre d'actions		50.220,794	39.213,182	25.021,016
VNI par action	CHF	193,80	184,33	168,56
I EUR				
Nombre d'actions		100.894,810	95.130,557	51.310,780
VNI par action	EUR	174,20	162,83	146,58
I USD				
Nombre d'actions		222.943,841	213.069,040	142.617,488
VNI par action	USD	249,79	228,67	204,70
P CHF				
Nombre d'actions		63.102,604	50.560,039	10.400,039
VNI par action	CHF	182,91	174,90	160,43
P EUR				
Nombre d'actions		77.198,446	61.268,020	30.586,908
VNI par action	EUR	195,99	184,14	166,00
P GBP				
Nombre d'actions		555,000	1.525,000	1.195,000
VNI par action	GBP	248,81	230,20	206,95
P USD				
Nombre d'actions		99.744,111	103.160,397	86.270,122
VNI par action	USD	236,58	217,74	195,42
R GBP				
Nombre d'actions		3.473,333	3.109,333	3.639,745
VNI par action	GBP	173,71	159,92	143,47

GLOBAL MACRO FUND

		31/12/25	31/12/24	31/12/23
Actifs Nets Totaux	EUR	104.977.420,23	90.135.601,53	63.046.882,17
I CHF				
Nombre d'actions		26.013,385	5.632,022	4.218,033
VNI par action	CHF	159,86	157,90	154,65
I EUR				
Nombre d'actions		81.431,098	104.394,997	93.782,217
VNI par action	EUR	174,59	168,98	162,42
I USD				
Nombre d'actions		278.712,419	256.572,609	145.763,524
VNI par action	USD	186,58	177,68	168,90
P CHF				
Nombre d'actions		37.264,683	4.994,010	4.254,438
VNI par action	CHF	142,07	141,31	139,25
P EUR				
Nombre d'actions		22.770,111	35.402,872	40.917,370
VNI par action	EUR	156,53	152,56	147,43

PROSPER FUNDS SICAV

Statistiques

GLOBAL MACRO FUND

		31/12/25	31/12/24	31/12/23
Actifs Nets Totaux	EUR	104.977.420,23	90.135.601,53	63.046.882,17
P USD				
Nombre d'actions		66.895,491	45.347,567	38.452,092
VNI par action	USD	186,55	178,87	171,18
R GBP				
Nombre d'actions		106.078,740	64.445,825	63.916,516
VNI par action	GBP	182,18	173,68	165,37

PLURIMI WORLD EQUITY

		31/12/25	31/12/24	06/12/24(*)
Actifs Nets Totaux	USD	167.328.199,39	58.805.125,15	44.521.233,18
I - EUR				
Nombre d'actions		420,000	420,000	420,000
VNI par action	EUR	1.249,31	1.169,40	1.200,00
I - USD				
Nombre d'actions		10.386,333	-	-
VNI par action	USD	1.387,44	-	-
S - EUR				
Nombre d'actions		2.061,355	660,000	660,000
VNI par action	EUR	1.251,35	1.169,45	1.200,00
S - GBP				
Nombre d'actions		61.523,698	26.072,000	17.350,000
VNI par action	GBP	1.317,79	1.166,37	1.200,00
S - USD				
Nombre d'actions		28.906,666	16.933,666	13.350,000
VNI par action	USD	1.391,36	1.146,35	1.200,00

PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY (lancé le 10/01/25)

		31/12/25	10/01/25(*)
Actifs Nets Totaux	USD	130.841.049,09	12,219,657.30
I - EUR			
Nombre d'actions		2.653,166	449,166
VNI par action	EUR	1.306,77	1.200,00
I - GBP			
Nombre d'actions		2.140,000	-
VNI par action	USD	1.311,36	-
I - USD			
Nombre d'actions		5.176,831	2.675,666
VNI par action	EUR	1.332,69	1.200,00
P - CHF			
Nombre d'actions		20.657,875	-
VNI par action	GBP	126,10	-
P - EUR			
Nombre d'actions		47.013,489	4.410,000
VNI par action	USD	129,56	120,00

(*) 1er Calcul VNI

PROSPER FUNDS SICAV

Statistiques

PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY (lancé le 10/01/25)

		31/12/25	10/01/25(*)
Actifs Nets Totaux	USD	130.841.049,09	12,219,657.30
P - USD			
Nombre d'actions		32.608,695	8.675,000
VNI par action	USD	132,12	120,00
S - EUR			
Nombre d'actions		2.170,719	534,165
VNI par action	EUR	1.316,75	1.200,00
S - GBP			
Nombre d'actions		23.375,469	860,500
VNI par action	GBP	1.341,48	1.200,00
S - USD			
Nombre d'actions		41.284,682	4.127,662
VNI par action	USD	1.351,83	1.200,00

(*) 1er Calcul VNI

PROSPER FUNDS SICAV

Changement dans le nombre d'actions en circulation du 01/01/25 au 31/12/25

PROSPER STARS & STRIPES FUND

	Nombre d'actions au 01/01/25	Nombre d'actions émises	Nombre d'actions rachetées	Nombre d'actions au 31/12/25
13	10.000.000,000	0,000	0,000	10.000.000,000
I CHF	39.213,182	17.535,754	6.528,142	50.220,794
I EUR	95.130,557	35.962,668	30.198,415	100.894,810
I USD	213.069,040	66.267,640	56.392,839	222.943,841
P CHF	50.560,039	27.856,565	15.314,000	63.102,604
P EUR	61.268,020	43.376,201	27.445,775	77.198,446
P GBP	1.525,000	0,000	970,000	555,000
P USD	103.160,397	20.661,008	24.077,294	99.744,111
R GBP	3.109,333	600,000	236,000	3.473,333

GLOBAL MACRO FUND

	Nombre d'actions au 01/01/25	Nombre d'actions émises	Nombre d'actions rachetées	Nombre d'actions au 31/12/25
I CHF	5.632,022	21.460,352	1.078,989	26.013,385
I EUR	104.394,997	24.029,539	46.993,438	81.431,098
I USD	256.572,609	57.275,114	35.135,304	278.712,419
P CHF	4.994,010	34.190,673	1.920,000	37.264,683
P EUR	35.402,872	9.575,000	22.207,761	22.770,111
P USD	45.347,567	25.707,960	4.160,036	66.895,491
R GBP	64.445,825	54.159,173	12.526,258	106.078,740

PLURIMI WORLD EQUITY

	Nombre d'actions au 01/01/25	Nombre d'actions émises	Nombre d'actions rachetées	Nombre d'actions au 31/12/25
I - EUR	420,000	0,000	0,000	420,000
I - USD	0,000	10.506,333	120,000	10.386,333
S - EUR	660,000	2.061,355	660,000	2.061,355
S - GBP	26.072,000	38.720,397	3.268,699	61.523,698
S - USD	16.933,666	23.993,000	12.020,000	28.906,666

PROSPER FUNDS SICAV

Changement dans le nombre d'actions en circulation du 01/01/25 au 31/12/25

PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY (lancé le 10/01/25)

	Nombre d'actions au 10/01/25	Nombre d'actions émises	Nombre d'actions rachetées	Nombre d'actions au 31/12/25
I - EUR	0,000	2.665,166	12,000	2.653,166
I - GBP	0,000	2.140,000	0,000	2.140,000
I - USD	0,000	8.387,831	3.211,000	5.176,831
P - CHF	0,000	21.737,875	1.080,000	20.657,875
P - EUR	0,000	57.356,876	10.343,387	47.013,489
P - USD	0,000	49.188,047	16.579,352	32.608,695
S - EUR	0,000	2.410,511	239,792	2.170,719
S - GBP	0,000	24.626,247	1.250,778	23.375,469
S - USD	0,000	42.724,144	1.439,462	41.284,682

PROSPER STARS & STRIPES FUND

Portefeuille-titres au 31/12/25

Description	Devise	Quantité/ Nominal	Prix de revient (en USD)	Valeur d'évaluation (en USD)	% actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou traitées sur un autre marché réglementé			128.796.680,63	138.466.967,52	94,99
Actions			128.796.680,63	138.466.967,52	94,99
États-Unis			118.941.346,56	128.411.363,39	88,09
AAR CORP	USD	37.203	3.183.511,46	3.080.036,37	2,11
AGILYSYS INC	USD	35.568	3.329.625,26	4.226.901,12	2,90
ALPHA TEKNOVA IN SHARES	USD	589.547	2.938.552,36	2.240.278,60	1,54
APPLIED OPTOELECTRONICS INC	USD	63.927	1.873.404,99	2.228.495,22	1,53
APTARGROUP INC	USD	20.261	2.448.698,89	2.471.031,56	1,70
ATI INC	USD	22.013	1.443.048,17	2.526.211,88	1,73
AZENTA RG --- REGISTERED SHS	USD	108.399	3.411.786,93	3.605.350,74	2,47
CCC INTELLIGENT SOLUTIONS HO	USD	464.140	3.497.340,81	3.689.913,00	2,53
CERTARA INC	USD	332.441	3.635.698,11	2.928.805,21	2,01
EVOLV TECH	USD	369.843	2.503.790,12	2.648.075,88	1,82
H B FULLER CO	USD	49.489	3.009.812,64	2.942.615,94	2,02
ITRON INC	USD	26.652	2.678.640,70	2.474.904,72	1,70
JANUS INTERNATIONAL GROUP IN	USD	586.366	4.558.565,43	3.834.833,64	2,63
KARMAN HOLDINGS INC	USD	36.085	2.207.755,84	2.640.339,45	1,81
LATHAM GROUP INC	USD	403.859	2.607.598,83	2.564.504,65	1,76
LIFE TIME GROUP HOLDINGS INC	USD	95.736	2.501.800,47	2.544.662,88	1,75
LITTELFUSE INC	USD	11.478	2.913.380,40	2.903.015,76	1,99
MAYVILLE ENGINEERING CO INC	USD	86.376	1.275.723,09	1.616.958,72	1,11
MESA LABORATORIES-REGISTERED SHS	USD	32.582	2.288.480,75	2.557.687,00	1,75
MODINE MANUFACTURING CO	USD	27.273	3.669.358,09	3.641.218,23	2,50
NCINO INC	USD	117.504	2.913.241,45	3.012.802,56	2,07
NEXTPOWER INC-CL A	USD	32.183	2.852.948,57	2.803.461,13	1,92
NLIGHT --- REGISTERED SHS	USD	82.096	1.642.704,86	3.079.420,96	2,11
NPK INTERNATIONAL INC	USD	339.693	2.358.288,01	4.049.140,56	2,78
OMNICELL INC	USD	66.017	2.227.929,41	2.990.570,10	2,05
ORMAT TECHNOLOGIES INC	USD	25.741	1.975.614,04	2.843.608,27	1,95
ORTHOPEDIATRICS CORP	USD	138.339	2.441.244,99	2.456.900,64	1,69
PARK AEROSPACE CORP	USD	177.102	2.626.378,46	3.779.356,68	2,59
PAR TECHNOLOGY CORP/DEL	USD	62.856	2.228.306,46	2.280.415,68	1,56
PDF SOLUTIONS INC	USD	129.904	3.179.695,88	3.706.161,12	2,54
PROCORE TECHNOLOGIES INC	USD	27.789	1.958.913,41	2.021.371,86	1,39
RALLIANT CORP	USD	102.484	4.600.810,33	5.217.460,44	3,58
REGAL REXNORD CORP	USD	25.291	3.546.918,86	3.548.833,12	2,43
REVVITY INC	USD	36.075	3.492.086,65	3.490.256,25	2,39
SENSIENT TECHNOLOGIES CORP	USD	37.215	3.550.035,95	3.496.349,25	2,40
SHOULDER INNOVATIONS INC	USD	93.762	1.404.844,63	1.340.796,60	0,92
SITIME CORP	USD	8.287	2.237.138,85	2.926.885,53	2,01
STANDARDAERO INC	USD	172.616	4.718.284,50	4.950.626,88	3,40
TRANSCAT INC	USD	68.548	4.567.131,61	3.888.728,04	2,67
VERTEX INC - CLASS A	USD	108.901	2.162.652,10	2.174.752,97	1,49
XOMETRY INC-A	USD	59.550	3.618.960,44	3.541.438,50	2,43
XPEL INC	USD	69.048	2.660.643,76	3.446.185,68	2,36
Israël			1.373.666,99	1.550.778,33	1,06
CELLEBRITE DI LTD	USD	86.011	1.373.666,99	1.550.778,33	1,06
Italie			2.496.823,62	2.327.984,60	1,60
STEVANATO GROUP SPA	USD	115.705	2.496.823,62	2.327.984,60	1,60

PROSPER STARS & STRIPES FUND

Portefeuille-titres au 31/12/25

Description	Devise	Quantité/ Nominal	Prix de revient (en USD)	Valeur d'évaluation (en USD)	% actifs nets
Royaume-Uni			5.984.843,46	6.176.841,20	4,24
BIRKENSTOCK HOLDING PLC	USD	77.123	3.262.276,42	3.154.330,70	2,16
GENIUS SPORTS LTD	USD	274.275	2.722.567,04	3.022.510,50	2,07
Total du portefeuille-titres			128.796.680,63	138.466.967,52	94,99

GLOBAL MACRO FUND

Portefeuille-titres au 31/12/25

Description	Devise	Quantité/ Nominal	Prix de revient (en EUR)	Valeur d'évaluation (en EUR)	% actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou traitées sur un autre marché réglementé			86.251.268,25	90.906.754,56	86,60
Actions			23.927.481,55	28.041.820,08	26,71
Allemagne			3.087.280,26	3.332.810,00	3,17
BILFINGER SE	EUR	3.800	340.007,30	408.120,00	0,39
COMMERZBANK AG	EUR	28.700	943.922,95	1.036.070,00	0,99
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	EUR	32.000	959.608,83	885.120,00	0,84
HEIDELBERG MATERIALS AG	EUR	4.500	843.741,18	1.003.500,00	0,96
Canada			5.828.370,32	7.402.194,03	7,05
ARC RESOURCES LTD	CAD	29.000	471.659,53	463.848,69	0,44
BARRICK MINING CORP	USD	34.000	1.275.452,86	1.260.760,36	1,20
CAMECO CORP	USD	18.900	1.452.498,09	1.472.315,55	1,40
FRANCO-NEVADA CORP	CAD	15.000	1.729.342,56	2.650.878,94	2,53
KINROSS GOLD CORP	CAD	49.000	526.098,86	1.176.681,78	1,12
SUNCOR ENERGY INC	USD	10.000	373.318,42	377.708,71	0,36
États-Unis			5.237.302,60	5.221.193,16	4,97
ADOBE INC	USD	3.300	1.384.138,99	983.410,96	0,94
ALPHABET INC-CL C	USD	3.480	877.263,16	929.817,36	0,89
COLGATE-PALMOLIVE CO	USD	2.000	166.424,84	134.565,12	0,13
ELI LILLY & CO	USD	1.000	865.205,59	915.049,60	0,87
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	USD	9.500	1.029.589,32	1.114.649,41	1,06
VISA INC-CLASS A SHARES	USD	3.830	914.680,70	1.143.700,71	1,09
France			789.058,20	1.051.886,00	1,00
DANONE	EUR	13.700	789.058,20	1.051.886,00	1,00
Italie			1.025.442,24	1.326.204,00	1,26
UNICREDIT SPA	EUR	18.700	1.025.442,24	1.326.204,00	1,26
Japon			2.472.711,29	2.873.285,04	2,74
HITACHI LTD	JPY	45.200	773.408,24	1.203.603,80	1,15
JAPAN POST HOLDINGS CO LTD	JPY	60.800	491.868,92	545.118,49	0,52
RECRUIT HOLDINGS CO LTD	JPY	23.400	1.207.434,13	1.124.562,75	1,07
Royaume-Uni			2.598.243,58	3.722.156,00	3,55
ASTRAZENECA PLC	GBP	6.400	999.614,40	1.010.777,07	0,96
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	EUR	252.000	899.802,40	1.196.748,00	1,14
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	GBP	115.000	698.826,78	1.514.630,93	1,44
Suède			1.545.281,47	1.489.609,31	1,42
SAAB AB-B	SEK	30.000	1.545.281,47	1.489.609,31	1,42
Suisse			1.343.791,59	1.622.482,54	1,55
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	CHF	4.600	1.343.791,59	1.622.482,54	1,55
Obligations			59.109.792,43	60.297.997,50	57,44
Allemagne			6.573.980,00	6.924.565,00	6,60
COMMERZBANK AKTIENGESELLSCHAFT 5.125% 18-01-30	EUR	2.000.000	2.092.200,00	2.119.800,00	2,02
DEUTSCHE BAHN AG 0.875% 11-07-31	EUR	1.000.000	888.700,00	898.095,00	0,86
DEUTSCHE BK 0.75% 17-02-27	EUR	2.000.000	1.853.180,00	1.995.690,00	1,90
DEUTSCHE BK 4.625% PERP	EUR	1.000.000	853.500,00	992.390,00	0,95
MERCEDESBEZ GROUP AG 0.75% 08-02-30	EUR	1.000.000	886.400,00	918.590,00	0,88
Belgique			4.156.946,58	4.249.254,03	4,05
ALIAxis FINANCE 0.875% 08-11-28	EUR	2.000.000	1.803.736,58	1.885.250,00	1,80
COFINIMMO 0.875% 02-12-30	EUR	100.000	85.910,00	88.513,50	0,08

GLOBAL MACRO FUND

Portefeuille-titres au 31/12/25

Description	Devise	Quantité/ Nominal	Prix de revient (en EUR)	Valeur d'évaluation (en EUR)	% actifs nets
COFINIMMO 1.0% 24-01-28	EUR	200.000	186.000,00	192.960,00	0,18
GROUPE BRUXELLES LAMBERT 0.125% 28-01-31	EUR	500.000	426.750,00	430.935,00	0,41
GROUPE BRUXELLES LAMBERT 4.0% 15-05-33	EUR	500.000	520.750,00	513.487,50	0,49
UCB 1.0% 30-03-28 EMTN	EUR	200.000	183.080,00	191.172,03	0,18
UCB 5.2% 21-11-29 EMTN	EUR	800.000	858.420,00	848.024,00	0,81
VGP 1.625% 17-01-27	EUR	100.000	92.300,00	98.912,00	0,09
États-Unis			13.812.265,51	13.490.651,97	12,85
GOLD SACH GR 3.5% 23-01-33	EUR	1.000.000	999.600,00	1.001.515,00	0,95
MORGAN STANLEY 1.875% 27-04-27	EUR	1.470.000	1.390.179,00	1.458.453,15	1,39
NETFLIX 3.625% 15-06-30	EUR	2.000.000	2.059.900,00	2.046.430,00	1,95
UNITED STATES TREAS INFLATION BONDS 0.125% 15-02-51	USD	4.000.000	2.305.526,25	2.301.586,94	2,19
UNITED STATES TREAS INFLATION BONDS 0.125% 15-02-52	USD	4.000.000	2.270.683,93	2.106.367,48	2,01
UNITED STATES TREAS INFLATION BONDS 1.5% 15-02-53	USD	4.000.000	3.106.451,39	2.908.686,46	2,77
UNITED STATES TREAS INFLATION BONDS 2.375% 15-02-55	USD	2.000.000	1.679.924,94	1.667.612,94	1,59
France			9.244.180,00	9.512.399,50	9,06
AYVENS 3.875% 24-01-28	EUR	500.000	511.750,00	512.322,50	0,49
BNP PAR 2.5% 31-03-32 EMTN	EUR	2.000.000	1.786.910,00	1.987.620,00	1,89
BPCE 3.125% 05-09-30 EMTN	EUR	2.000.000	2.009.400,00	1.995.130,00	1,90
CARREFOUR S A 4.375% 14-11-31	EUR	1.000.000	1.055.500,00	1.050.035,00	1,00
LA MONDIALE 0.75% 20-04-26	EUR	1.000.000	921.870,00	993.980,00	0,95
SG 0.875% 24-09-29 EMTN	EUR	2.000.000	1.830.000,00	1.843.770,00	1,76
TIKEHAU CAPITAL 1.625% 31-03-29	EUR	1.200.000	1.128.750,00	1.129.542,00	1,08
Guernesey			2.048.000,00	2.029.010,00	1,93
PERSHING SQUARE 4.25% 29-04-30	EUR	2.000.000	2.048.000,00	2.029.010,00	1,93
Italie			3.695.075,00	3.993.590,00	3,80
INTE 0.625% 24-02-26 EMTN	EUR	2.000.000	1.817.555,00	1.995.260,00	1,90
UNICREDIT 0.325% 19-01-26 EMTN	EUR	2.000.000	1.877.520,00	1.998.330,00	1,90
Japon			1.021.650,00	1.010.505,00	0,96
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP 3.556% 05- 09-32	EUR	1.000.000	1.021.650,00	1.010.505,00	0,96
Luxembourg			1.000.000,00	1.038.100,00	0,99
SG ISSUER ZCP 09-01-30	EUR	1.000.000	1.000.000,00	1.038.100,00	0,99
Pays-Bas			9.350.490,00	9.624.009,50	9,17
ASN BANK NV 3.625% 21-10-31	EUR	1.000.000	1.012.435,00	1.006.240,00	0,96
BAYER CAP 1.5% 26-06-26	EUR	2.000.000	1.883.280,00	1.990.990,00	1,90
CTP NV 0.75% 18-02-27 EMTN	EUR	300.000	284.080,00	293.899,50	0,28
CTP NV 1.25% 21-06-29 EMTN	EUR	800.000	728.400,00	752.168,00	0,72
PROSUS NV 1.207% 19-01-26 EMTN	EUR	2.000.000	1.911.240,00	1.997.930,00	1,90
PROSUS NV 1.288% 13-07-29 EMTN	EUR	500.000	449.500,00	467.837,50	0,45
PROSUS NV 1.539% 03-08-28 EMTN	EUR	500.000	452.000,00	481.257,50	0,46
STELLANTIS NV 2.75% 15-05-26	EUR	1.000.000	1.006.155,00	1.000.510,00	0,95
STELLANTIS NV 3.375% 19-11-28	EUR	600.000	597.900,00	616.677,00	0,59
STELLANTIS NV 4.25% 16-06-31	EUR	1.000.000	1.025.500,00	1.016.500,00	0,97
Roumanie			4.876.675,34	4.927.325,00	4,69
ROMANIAN GOVERNMENT INTL BOND 3.624% 26-05-30	EUR	5.000.000	4.876.675,34	4.927.325,00	4,69

GLOBAL MACRO FUND

Portefeuille-titres au 31/12/25

Description	Devise	Quantité/ Nominal	Prix de revient (en EUR)	Valeur d'évaluation (en EUR)	% actifs nets
Royaume-Uni			3.330.530,00	3.498.587,50	3,33
BP CAP MK 3.25% PERP	EUR	1.500.000	1.444.650,00	1.501.252,50	1,43
UBS AG LONDON BRANCH 1.5% 10-04-26	EUR	1.000.000	871.380,00	997.880,00	0,95
VODAFONE GROUP 2.2% 25-08-26	EUR	1.000.000	1.014.500,00	999.455,00	0,95
Actions/Parts de fonds d'investissements			324.986,85	199.129,48	0,19
États-Unis			324.986,85	199.129,48	0,19
SABA CAPITAL INCOME OPPORTUNITIES FUND	USD	33.362	324.986,85	199.129,48	0,19
Produits structurés			2.889.007,42	2.367.807,50	2,26
Luxembourg			2.000.000,00	1.833.600,00	1,75
SG ISSUER ZCP 29-12-34 EMTN	EUR	2.000.000	2.000.000,00	1.833.600,00	1,75
Suisse			889.007,42	534.207,50	0,51
UBS AG LONDON BRANCH 0.00 20-27 07/07U	USD	10.000	889.007,42	534.207,50	0,51
Organismes de placement collectif			3.560.683,56	3.649.799,77	3,48
Actions/Parts de fonds d'investissements			3.560.683,56	3.649.799,77	3,48
Irlande			953.976,60	936.491,13	0,89
TABULA US ENHANCED INFLATION UCITS ETF EUR HEDGED	EUR	8.583	953.976,60	936.491,13	0,89
Luxembourg			2.606.706,96	2.713.308,64	2,58
MULTI-UNITS LUXEMBOURG - LYXOR US CURVE STEEPENING 2-10 UCI	EUR	1.000	85.427,00	84.720,00	0,08
PROSPER FD SIC PLURIM WLD LG SH EQ I EUR	EUR	1.187	1.513.279,96	1.555.824,64	1,48
PROSPER FD SIC PLURIM WLD LG SH EQ P EUR	EUR	4.200	504.000,00	545.832,00	0,52
PROSPER FDS SICAV - PLURIMI WLD EQ I EUR	EUR	420	504.000,00	526.932,00	0,50
Total du portefeuille-titres			89.811.951,81	94.556.554,33	90,07

PLURIMI WORLD EQUITY

Portefeuille-titres au 31/12/25

Description	Devise	Quantité/ Nominal	Prix de revient (en USD)	Valeur d'évaluation (en USD)	% actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou traitées sur un autre marché réglementé			143.589.178,86	167.120.660,64	99,88
Actions			143.589.178,86	167.120.660,64	99,88
Allemagne			13.737.559,40	16.835.952,15	10,06
COMMERZBANK AG	EUR	144.700	4.667.564,76	6.134.939,23	3,67
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	EUR	133.500	4.467.638,77	4.336.785,81	2,59
HEIDELBERG MATERIALS AG	EUR	24.300	4.602.355,87	6.364.227,11	3,80
Canada			6.075.660,39	6.140.550,00	3,67
BARRICK MINING CORP	USD	141.000	6.075.660,39	6.140.550,00	3,67
Espagne			5.075.899,02	5.264.927,22	3,15
REPSOL SA	EUR	281.500	5.075.899,02	5.264.927,22	3,15
États-Unis			76.541.738,99	91.147.642,00	54,47
ADOBE INC	USD	11.700	4.938.127,99	4.094.883,00	2,45
ALPHABET INC-CL C	USD	25.000	4.546.714,06	7.845.000,00	4,69
APPLE INC	USD	21.500	4.616.845,36	5.844.990,00	3,49
APPLIED MATERIALS INC	USD	26.800	4.595.829,61	6.887.332,00	4,12
DR HORTON INC	USD	28.600	4.034.688,53	4.119.258,00	2,46
ELI LILLY & CO	USD	5.900	4.651.772,22	6.340.612,00	3,79
FIRST SOLAR INC	USD	22.100	4.065.674,88	5.773.183,00	3,45
FORTINET INC	USD	51.700	5.188.557,90	4.105.497,00	2,45
GENERAL ELECTRIC	USD	25.300	5.181.385,68	7.793.159,00	4,66
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	USD	49.400	5.906.006,02	6.807.320,00	4,07
JOHNSON & JOHNSON	USD	23.700	4.068.902,32	4.904.715,00	2,93
NVIDIA CORP	USD	38.600	5.207.583,20	7.198.900,00	4,30
SERVICENOW INC	USD	24.500	5.000.795,55	3.753.155,00	2,24
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	USD	9.100	4.179.464,56	4.125.576,00	2,47
VISA INC-CLASS A SHARES	USD	15.600	5.170.415,12	5.471.076,00	3,27
WALMART INC	USD	54.600	5.188.975,99	6.082.986,00	3,64
France			4.205.197,87	5.067.794,03	3,03
DANONE	EUR	56.200	4.205.197,87	5.067.794,03	3,03
Hong-Kong			5.163.704,38	4.942.721,00	2,95
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	USD	30.100	5.163.704,38	4.942.721,00	2,95
Italie			4.659.623,32	6.413.483,54	3,83
UNICREDIT SPA	EUR	77.000	4.659.623,32	6.413.483,54	3,83
Japon			10.585.233,41	10.904.467,47	6,52
HITACHI LTD	JPY	183.000	4.789.475,67	5.723.092,16	3,42
RECRUIT HOLDINGS CO LTD	JPY	91.800	5.795.757,74	5.181.375,31	3,10
Royaume-Uni			8.830.809,49	10.386.469,77	6,21
ASTRAZENECA PLC	GBP	27.400	4.938.335,15	5.082.302,41	3,04
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	EUR	951.000	3.892.474,34	5.304.167,36	3,17
Suède			4.672.883,98	4.548.626,30	2,72
SAAB AB-B	SEK	78.000	4.672.883,98	4.548.626,30	2,72
Suisse			4.040.868,61	5.468.027,16	3,27
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	CHF	13.200	4.040.868,61	5.468.027,16	3,27
Total du portefeuille-titres			143.589.178,86	167.120.660,64	99,88

PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY (lancé le 10/01/25)

Portefeuille-titres au 31/12/25

Description	Devise	Quantité/ Nominal	Prix de revient (en USD)	Valeur d'évaluation (en USD)	% actifs nets
Valeurs mobilières admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs et/ou traitées sur un autre marché réglementé			95.030.974,60	106.098.478,39	81,09
Actions			65.085.608,70	75.705.298,39	57,86
Allemagne			7.754.861,66	10.053.038,32	7,68
COMMERZBANK AG	EUR	102.600	3.257.341,74	4.349.998,38	3,32
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	EUR	51.400	1.750.202,62	1.669.743,75	1,28
HEIDELBERG MATERIALS AG	EUR	15.400	2.747.317,30	4.033.296,19	3,08
Canada			2.396.736,41	2.421.380,00	1,85
BARRICK MINING CORP	USD	55.600	2.396.736,41	2.421.380,00	1,85
Espagne			1.792.528,47	1.844.127,26	1,41
REPSOL SA	EUR	98.600	1.792.528,47	1.844.127,26	1,41
États-Unis			35.569.266,80	41.538.833,00	31,75
ADOBE INC	USD	5.700	2.175.272,87	1.994.943,00	1,52
ALPHABET INC-CL C	USD	10.000	2.012.286,10	3.138.000,00	2,40
APPLE INC	USD	15.100	3.231.235,93	4.105.086,00	3,14
APPLIED MATERIALS INC	USD	13.000	2.309.525,31	3.340.870,00	2,55
DR HORTON INC	USD	10.500	1.427.107,02	1.512.315,00	1,16
ELI LILLY & CO	USD	2.300	1.861.039,42	2.471.764,00	1,89
FIRST SOLAR INC	USD	7.700	1.388.205,51	2.011.471,00	1,54
FORTINET INC	USD	36.100	3.662.308,67	2.866.701,00	2,19
GENERAL ELECTRIC	USD	9.900	2.028.755,68	3.049.497,00	2,33
HARTFORD INSURANCE GROUP INC	USD	20.100	2.398.460,24	2.769.780,00	2,12
JOHNSON & JOHNSON	USD	10.700	1.814.181,34	2.214.365,00	1,69
NVIDIA CORP	USD	16.000	2.150.492,56	2.984.000,00	2,28
SERVICENOW INC	USD	11.500	2.171.772,93	1.761.685,00	1,35
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	USD	6.000	2.815.862,98	2.720.160,00	2,08
VISA INC-CLASS A SHARES	USD	5.900	1.977.299,14	2.069.189,00	1,58
WALMART INC	USD	22.700	2.145.461,10	2.529.007,00	1,93
France			1.575.328,59	1.911.694,55	1,46
DANONE	EUR	21.200	1.575.328,59	1.911.694,55	1,46
Hong-Kong			2.016.798,10	1.904.836,00	1,46
FUTU HOLDINGS LTD-ADR	USD	11.600	2.016.798,10	1.904.836,00	1,46
Italie			1.739.716,87	2.390.480,23	1,83
UNICREDIT SPA	EUR	28.700	1.739.716,87	2.390.480,23	1,83
Japon			5.313.812,65	5.771.028,61	4,41
HITACHI LTD	JPY	119.200	3.008.194,89	3.727.828,33	2,85
RECRUIT HOLDINGS CO LTD	JPY	36.200	2.305.617,76	2.043.200,28	1,56
Royaume-Uni			3.177.190,48	3.716.183,30	2,84
ASTRAZENECA PLC	GBP	9.700	1.734.838,88	1.799.209,25	1,38
INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	EUR	343.700	1.442.351,60	1.916.974,05	1,47
Suède			2.119.240,18	2.041.050,26	1,56
SAAB AB-B	SEK	35.000	2.119.240,18	2.041.050,26	1,56
Suisse			1.630.128,49	2.112.646,86	1,61
ROCHE HOLDING AG-GENUSSCHEIN	CHF	5.100	1.630.128,49	2.112.646,86	1,61
Obligations			29.945.365,90	30.393.180,00	23,23
États-Unis			23.944.830,90	24.262.650,00	18,54
JPM CHASE 4.452% 05-12-29	USD	6.000.000	5.947.527,50	6.063.000,00	4,63
META PLATFORMS 4.6% 15-05-28	USD	6.000.000	6.058.090,00	6.111.090,00	4,67

PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY (lancé le 10/01/25)

Portefeuille-titres au 31/12/25

Description	Devise	Quantité/ Nominal	Prix de revient (en USD)	Valeur d'évaluation (en USD)	% actifs nets
MORGAN STANLEY 4.431% 23-01-30	USD	6.000.000	5.918.313,50	6.035.910,00	4,61
WELLS FARGO 4.9% 24-01-28	USD	6.000.000	6.020.899,90	6.052.650,00	4,63
Royaume-Uni			6.000.535,00	6.130.530,00	4,69
NATWEST GROUP 4.964% 15-08-30	USD	6.000.000	6.000.535,00	6.130.530,00	4,69
Organismes de placement collectif			10.199.473,03	10.751.396,76	8,22
Actions/Parts de fonds d'investissements			10.199.473,03	10.751.396,76	8,22
Irlande			10.199.473,03	10.751.396,76	8,22
ISHARES \$ SHORT DURATION CORP BOND UCITS ETF USD (ACC)	USD	850.000	5.147.873,12	5.370.300,00	4,10
ISHARES CORP BOND UCITS ETF USD (ACC)	USD	849.960	5.051.599,91	5.381.096,76	4,11
Total du portefeuille-titres			105.230.447,63	116.849.875,15	89,31

PROSPER FUNDS SICAV

Notes aux états financiers - Etat des instruments dérivés

Contrats de change à terme

Au 31 décembre 2025, les contrats de change à terme ouverts sont les suivants :

PROSPER STARS & STRIPES FUND

Devise achetée	Quantité achetée	Devise vendue	Quantité vendue	Échéance	Non réalisé (en USD)	Contrepartie
USD	70.952,03	EUR	60.351,68	05/01/26	61,95 *	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
USD	276.184,12	CHF	217.983,84	05/01/26	960,93 *	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
USD	180.133,21	CHF	142.539,48	06/01/26	145,46 *	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
USD	26.433,78	EUR	22.512,00	06/01/26	-10,43 *	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
CHF	22.106.825,49	USD	27.965.595,13	15/01/26	-23.528,14 *	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
EUR	33.973.110,51	USD	40.010.407,22	15/01/26	-86.150,51 *	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
GBP	773.402,40	USD	1.039.031,60	15/01/26	1.236,02 *	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
USD	34.633,94	GBP	25.828,74	15/01/26	-107,11 *	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
USD	1.144.756,14	EUR	972.927,33	15/01/26	1.398,35 *	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
USD	930.775,87	CHF	737.358,29	15/01/26	-1.210,10 *	CACEIS Bank, Luxembourg Branch
					-107.203,58	

GLOBAL MACRO FUND

Devise achetée	Quantité achetée	Devise vendue	Quantité vendue	Échéance	Non réalisé (en EUR)	Contrepartie
USD	3.290.000,00	EUR	2.801.907,68	06/01/26	-1.125,38 *	Crédit Agricole Lxg, Private Bk
CHF	9.300.000,00	EUR	10.013.047,52	20/03/26	27.582,02 *	Crédit Agricole Lxg, Private Bk
EUR	11.969.591,90	USD	14.100.000,00	20/03/26	7.846,35 *	Crédit Agricole Lxg, Private Bk
GBP	19.200.000,00	EUR	21.746.517,16	20/03/26	158.608,30 *	Crédit Agricole Lxg, Private Bk
USD	64.200.000,00	EUR	54.493.631,73	20/03/26	-29.490,90 *	Crédit Agricole Lxg, Private Bk
					163.420,39	

PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY (lancé le 10/01/25)

Devise achetée	Quantité achetée	Devise vendue	Quantité vendue	Échéance	Non réalisé (en USD)	Contrepartie
CHF	2.600.000,00	USD	3.302.857,21	20/03/26	5.964,29 *	Crédit Agricole Lxg, Private Bk
EUR	12.300.000,00	USD	14.505.442,50	20/03/26	-6.757,20 *	Crédit Agricole Lxg, Private Bk
GBP	33.800.000,00	USD	45.273.485,00	20/03/26	180.568,33 *	Crédit Agricole Lxg, Private Bk
					179.775,42	

Au titre de ces contrats dérivés OTC, il n'y a pas de collatéral maintenu auprès de la contrepartie.
Les contrats marqués par un * concernent spécifiquement la couverture du risque de change.

PROSPER FUNDS SICAV

Notes aux états financiers - Etat des instruments dérivés

Contrats futures

Au 31 décembre 2025, les contrats futures ouverts sont les suivants :

GLOBAL MACRO FUND

Quantité Achat/ (Vente)	Dénomination	Devise	Engagement (en EUR) (en valeur absolue)	Non réalisé (en EUR)	Contrepartie
Futures sur indices					
110,00	DJ ESTOXX50D 12/26	EUR	28.490,00	95.700,00	CACEIS Bank, Paris
130,00	DJ ESTOXX50D 12/28	EUR	33.670,00	241.800,00	CACEIS Bank, Paris
110,00	DJ ESTOXX50D 12/29	EUR	28.490,00	201.300,00	CACEIS Bank, Paris
200,00	FTSE DVD IDX 12/27	GBP	13.422,67	60.699,77	CACEIS Bank, Paris
2,00	XEUR FEBD EURO STOXX 12/28	EUR	80,00	3.110,00	CACEIS Bank, Paris
Futures sur obligations					
-13,00	JPN 10 YEARS BOND 03/26	JPY	6.445.866,04	60.731,44	CACEIS Bank, Paris
				663.341,21	

PROSPER FUNDS SICAV

Notes aux états financiers - Etat des instruments dérivés

Contracts for Difference ("CFD")

Au 31 décembre 2025, les positions ouvertes sur Contracts for Difference ("CFD") sont les suivantes :

PROSPER STARS & STRIPES FUND

Quantité	Long / Devise Court	Description	Contrepartie	Nominal	Non réalisé (en USD)
27.382	Court USD	ACI WORLDWIDE INC	Goldman Sachs BankSE	1.309.133,42	-32.258,95
74.850	Court USD	ALBERTSONS COS INC - CLASS A	Goldman Sachs BankSE	1.285.174,50	32.445,32
63.341	Court USD	ALLIANCE LAUNDRY HOLDINGS IN	Goldman Sachs BankSE	1.288.989,35	147.256,26
62.834	Court USD	ALPHA & OMEGA SEMICONDUCTOR	Goldman Sachs BankSE	1.244.741,54	-59.544,01
343.349	Court USD	ARDAGH METAL PACKAGING SA	Goldman Sachs BankSE	1.407.730,90	-114.933,94
89.158	Court USD	ASANA INC	Goldman Sachs BankSE	1.222.356,18	-135.949,12
26.327	Court USD	BALL CORP	Goldman Sachs BankSE	1.394.541,19	-80.193,77
6.426	Court USD	CRA INTL	Goldman Sachs BankSE	1.289.666,07	-145.493,35
93.240	Court USD	DXC TECHNOLOGY CO	Goldman Sachs BankSE	1.365.966,00	-188.876,67
106.968	Court USD	EMBECTA CORP	Goldman Sachs BankSE	1.270.779,84	-22.012,43
10.359	Court USD	ESAB CORP	Goldman Sachs BankSE	1.157.307,48	-58.246,54
21.525	Court USD	ETSY INC	Goldman Sachs BankSE	1.193.346,00	-31.171,83
30.601	Court USD	EXLSERVICE HOLDINGS INC	Goldman Sachs BankSE	1.298.706,44	-91.698,07
17.517	Court USD	EXPONENT INC	Goldman Sachs BankSE	1.216.730,82	20.228,35
112.317	Court USD	FASTLY INC - CLASS A	Goldman Sachs BankSE	1.143.387,06	117.334,27
11.571	Court USD	FEDERAL SIGNAL CORP	Goldman Sachs BankSE	1.256.494,89	21.452,88
8.013	Court USD	FTI CONSULTING INC	Goldman Sachs BankSE	1.368.860,79	-53.561,68
482.869	Court USD	FUBOTV INC -CLASS A	Goldman Sachs BankSE	1.216.829,88	93.766,52
47.194	Court USD	GENTEX CORP	Goldman Sachs BankSE	1.098.204,38	13.766,44
30.797	Court USD	GITLAB INC-CL A	Goldman Sachs BankSE	1.155.811,41	104.317,19
153.699	Court USD	GLOBAL BUSINESS TRAVEL GROUP INC	Goldman Sachs BankSE	1.175.797,35	21.652,00
16.547	Court USD	GOOSEHEAD INSURANCE INC -A	Goldman Sachs BankSE	1.218.686,55	-37.117,59
17.360	Court USD	HEXCEL CORP	Goldman Sachs BankSE	1.282.904,00	-23.146,62
59.372	Court USD	IBOTTA INC-CL A	Goldman Sachs BankSE	1.349.525,56	1.590,22
24.573	Court USD	INNODATA ISOGEN INC	Goldman Sachs BankSE	1.251.994,35	23.325,39
13.854	Court USD	INSIGHT ENTERPRISES INC	Goldman Sachs BankSE	1.128.685,38	35.378,76
4.230	Court USD	INSTALLED BUILDING PRODUCTS	Goldman Sachs BankSE	1.097.219,70	-2.749,35
41.300	Court USD	INTERFACE INC	Goldman Sachs BankSE	1.153.096,00	-45.360,28
20.476	Court USD	KONTOOR BRANDS --- REGISTERED SHS	Goldman Sachs BankSE	1.250.878,84	129.466,20
63.162	Court USD	LYFT INC-A	Goldman Sachs BankSE	1.223.447,94	-2.250,96
30.242	Court USD	MAPLEBEAR INC	Goldman Sachs BankSE	1.360.285,16	-26.673,52
7.880	Court USD	MARZETTI COMPANY/THE	Goldman Sachs BankSE	1.295.629,60	47.871,01
72.708	Court USD	MCGRAW HILL INC	Goldman Sachs BankSE	1.199.682,00	14.161,21
12.903	Court USD	MOHAWK INDUSTRIES INC	Goldman Sachs BankSE	1.410.297,90	7.992,91
26.301	Court USD	MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	Goldman Sachs BankSE	1.227.730,68	-14.669,95
144.133	Court USD	NAVITAS SEMICONDUCTOR CORP	Goldman Sachs BankSE	1.029.109,62	51.898,43
126.358	Court USD	NCR VOYIX	Goldman Sachs BankSE	1.288.851,60	-48.581,36
20.343	Court USD	PARSONS CORP	Goldman Sachs BankSE	1.257.197,40	68.892,65
111.889	Court USD	PATTERN GROUP INC-CL A	Goldman Sachs BankSE	1.291.199,06	284.623,74
43.309	Court USD	ROBERT HALF INC	Goldman Sachs BankSE	1.176.272,44	4.758,91
13.131	Court USD	ROGERS CORP	Goldman Sachs BankSE	1.202.405,67	25.156,52
12.574	Court USD	RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	Goldman Sachs BankSE	1.189.751,88	-3.939,43
77.384	Court USD	SENTINELONE INC -CLASS A	Goldman Sachs BankSE	1.160.760,00	45.895,28
100.536	Court USD	SHENANDOAH TELECOMMUNICATIONS CO	Goldman Sachs BankSE	1.162.196,16	-90.026,36
30.976	Court USD	SILGAN HOLDINGS INC	Goldman Sachs BankSE	1.250.501,12	-20.057,56
168.593	Court USD	SPRINKLR INC-A	Goldman Sachs BankSE	1.311.653,54	-94.526,41
14.321	Court USD	SPROUTS FARMERS MARKET INC	Goldman Sachs BankSE	1.140.954,07	30.539,35
17.329	Court USD	TENNANT CO	Goldman Sachs BankSE	1.277.147,30	-33.742,87
130.209	Court USD	UTZ BRANDS INC	Goldman Sachs BankSE	1.351.569,42	-105.730,97
41.715	Court USD	VIA TRANSPORTATION INC-CL A	Goldman Sachs BankSE	1.210.152,15	223.141,13
20.664	Court USD	VITA COCO CO INC/THE	Goldman Sachs BankSE	1.095.398,64	11.542,68
200.806	Court USD	WEAVE COMMUNICATIONS INC	Goldman Sachs BankSE	1.524.117,54	-319.712,86
11.978	Court USD	WIX.COM LTD	Goldman Sachs BankSE	1.244.394,42	-82.936,28

PROSPER FUNDS SICAV

Notes aux états financiers - Etat des instruments dérivés

Contracts for Difference ("CFD")

PROSPER STARS & STRIPES FUND

Quantité	Long / Devise Court		Description	Contrepartie	Nominal	Non réalisé (en USD)
16.119	Court	USD	WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC	Goldman Sachs BankSE	1.217.951,64	-44.882,97
452.351	Court	USD	XEROX HOLDINGS CORP	Goldman Sachs BankSE	1.074.333,63	108.209,45
41.379	Court	USD	YELP -A-	Goldman Sachs BankSE	1.257.507,81	-56.973,57
53.391	Court	USD	AEHR TEST SYSTEMS	Goldman Sachs BankSE	1.077.773,67	4.940,89
6.271	Court	USD	UFP TECHNOLOGIES INC	Goldman Sachs BankSE	1.392.356,73	-12.050,99
238.169	Court	USD	UNDER ARMOUR - CLASS C	Goldman Sachs BankSE	1.143.211,20	-152.397,97
					73.137.385,86	-539.864,27

PROSPER FUNDS SICAV

Notes aux états financiers - Etat des instruments dérivés

Contracts for Difference ("CFD")

PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY (lancé le 10/01/25)

Quantité	Long / Court	Devise	Description	Contrepartie	Nominal	Non réalisé (en USD)
5.700	Long	USD	ADOBE INC	Société Générale	1.994.943,00	-
9.700	Long	USD	ALPHABET INC-CL C	Société Générale	3.043.860,00	-
1.600	Long	USD	APPLE INC	Société Générale	434.976,00	-
8.600	Long	USD	APPLIED MATERIALS INC	Société Générale	2.210.114,00	-
8.500	Long	GBP	ASTRAZENECA PLC	Société Générale	1.576.626,66	-
55.700	Long	USD	BARRICK MINING CORP	Société Générale	2.425.735,00	-
8.600	Long	EUR	COMMERZBANK AG	Société Générale	364.619,75	-
21.300	Long	EUR	DANONE	Société Générale	1.920.711,97	-
51.600	Long	EUR	DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	Société Générale	1.676.240,81	-
10.500	Long	USD	DR HORTON INC	Société Générale	1.512.315,00	-
2.300	Long	USD	ELI LILLY & CO	Société Générale	2.471.764,00	-
6.230	Long	USD	FIRST SOLAR INC	Société Générale	1.627.462,90	-
3.900	Long	USD	FORTINET INC	Société Générale	309.699,00	-
11.600	Long	USD	FUTU HOLDINGS LTD-ADR	Société Générale	1.904.836,00	-
9.900	Long	USD	GENERAL ELECTRIC	Société Générale	3.049.497,00	-
19.000	Long	USD	HARTFORD INSURANCE GROUP INC	Société Générale	2.618.200,00	-
3.400	Long	EUR	HEIDELBERG MATERIALS AG	Société Générale	890.467,99	-
25.300	Long	JPY	HITACHI LTD	Société Générale	791.225,31	-
374.600	Long	EUR	INTL CONSOLIDATED AIRLINE-DI	Société Générale	2.089.317,66	-
7.300	Long	USD	JOHNSON & JOHNSON	Société Générale	1.510.735,00	-
14.500	Long	USD	NVIDIA CORP	Société Générale	2.704.250,00	-
37.800	Long	JPY	RECRUIT HOLDINGS CO LTD	Société Générale	2.133.507,48	-
98.600	Long	EUR	REPSOL SA	Société Générale	1.844.127,26	-
5.000	Long	CHF	ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	Société Générale	2.071.222,41	-
35.000	Long	SEK	SAAB AB-B	Société Générale	2.041.050,26	-
11.000	Long	USD	SERVICENOW INC	Société Générale	1.685.090,00	-
29.700	Long	EUR	UNICREDIT SPA	Société Générale	2.473.772,22	-
2.400	Long	USD	VERTEX PHARMACEUTICALS INC	Société Générale	1.088.064,00	-
5.900	Long	USD	VISA INC-CLASS A SHARES	Société Générale	2.069.189,00	-
22.700	Long	USD	WALMART INC	Société Générale	2.529.007,00	-
11.400	Court	EUR	ADIDAS AG	Société Générale	2.263.364,81	-
900	Court	DKK	AP MOLLER-MAERSK A/S-B	Société Générale	2.071.837,35	-
15.900	Court	USD	AVIS BUDGET GROUP	Société Générale	2.040.288,00	-
42.800	Court	EUR	BASF SE	Société Générale	2.233.338,82	-
72.900	Court	AUD	BHP GROUP LTD-DI	Société Générale	2.211.410,26	-
90.300	Court	USD	CAESARS ENTERTAINMENT INC	Société Générale	2.112.117,00	-
129.300	Court	EUR	CARREFOUR SA	Société Générale	2.160.916,36	-
10.400	Court	USD	CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	Société Générale	2.171.000,00	-
14.500	Court	USD	CHEVRON CORP	Société Générale	2.209.945,00	-
15.650	Court	USD	CONSTELLATION BRANDS INC-A	Société Générale	2.159.074,00	-
93.450	Court	USD	DOW INC	Société Générale	2.184.861,00	-
76.100	Court	JPY	EISAI CO LTD	Société Générale	2.262.439,20	-
50.200	Court	USD	EXELON CORP	Société Générale	2.188.218,00	-
7.400	Court	USD	FEDEX CORP	Société Générale	2.137.564,00	-
6.200	Court	EUR	KERING	Société Générale	2.191.758,59	-
164.900	Court	HKD	MEITUAN-CLASS B	Société Générale	2.188.505,02	-
137.100	Court	JPY	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GRO	Société Générale	2.180.550,13	-
206.000	Court	USD	MOBILEYE GLOBAL INC-A	Société Générale	2.150.640,00	-
70.400	Court	USD	MODERNA INC	Société Générale	2.076.096,00	-
2.220.000	Court	JPY	NTT INC	Société Générale	2.233.525,99	-
29.900	Court	USD	ONEOK INC	Société Générale	2.197.650,00	-
11.200	Court	USD	ORACLE CORP	Société Générale	2.182.992,00	-
25.600	Court	EUR	PERNOD RICARD SA	Société Générale	2.197.818,75	-
4.700	Court	USD	ROPER TECHNOLOGIES INC	Société Générale	2.092.111,00	-

PROSPER FUNDS SICAV

Notes aux états financiers - Etat des instruments dérivés

Contracts for Difference ("CFD")

PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY (lancé le 10/01/25)

Quantité	Long / Devise Court	Description	Contrepartie	Nominal	Non réalisé (en USD)
82.700	Court EUR	STMICROELECTRONICS NV	Société Générale	2.179.180,82	-
181.000	Court EUR	STORA ENSO OYJ-R SHS	Société Générale	2.275.620,19	-
71.100	Court USD	SUPER MICRO COMPUTER INC	Société Générale	2.081.097,00	-
172.800	Court CAD	TELUS CORP	Société Générale	2.280.436,25	-
107.500	Court JPY	TOYOTA MOTOR CORP	Société Générale	2.301.636,62	-
18.000	Court EUR	VOLKSWAGEN AG-PREF	Société Générale	2.189.057,36	-
				120.692.040,19	-

Pour le compartiment PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY (lancé le 10/01/25), tous les achats et ventes de CFD avaient été enregistrés sur un compte non réalisé jusqu'à la réinitialisation de fin de mois, de ce fait il n'y a plus de non réalisé au 31 décembre 2025.

PROSPER FUNDS SICAV

Autres notes aux états financiers

1 - Généralités

Prosper Funds SICAV (la "SICAV") a été constituée le 11 décembre 2009 sous forme d'une Société d'Investissement à Capital Variable de droit luxembourgeois. Elle relève de la partie I de la loi du 17 décembre 2010, telle que modifiée concernant les Organismes de Placement Collectif.

Les statuts de Prosper Funds SICAV ont été déposés auprès du Greffe du Tribunal d'Arrondissement de et à Luxembourg où toute personne intéressée peut les consulter ou en obtenir une copie.

Les statuts, les rapports semestriels et annuels peuvent être obtenus gratuitement au siège social de la SICAV. La valeur nette d'inventaire, le prix d'émission et le prix de rachat, ainsi que tous les avis destinés aux porteurs d'actions, sont disponibles au siège de la banque dépositaire.

Prosper Funds SICAV est constituée sous forme d'une SICAV à compartiments multiples. A la date de ce rapport, 4 compartiments sont actifs et sont composés de plusieurs classes d'actions dont les caractéristiques sont définies ci-dessous et dans le prospectus de la SICAV :

Prosper Stars & Stripes Fund :

- classe «Prosper Stars & Stripes Fund I EUR» libellée en EUR et réservée aux investisseurs institutionnels ;
- classe «Prosper Stars & Stripes Fund I USD» libellée en USD et réservée aux investisseurs institutionnels ;
- classe «Prosper Stars & Stripes Fund I CHF» libellée en CHF et réservée aux investisseurs institutionnels ;
- classe «Prosper Stars & Stripes Fund P EUR» libellée en EUR et destinée à tous types d'investisseurs ;
- classe «Prosper Stars & Stripes Fund P USD» libellée en USD et destinée à tous types d'investisseurs ;
- classe «Prosper Stars & Stripes Fund P CHF» libellée en CHF et destinée à tous types d'investisseurs ;
- classe «Prosper Stars & Stripes Fund P GBP» libellée en GBP et destinée à tous types d'investisseurs ;
- classe «Prosper Stars & Stripes Fund R GBP» libellée en GBP et destinée à tous types d'investisseurs ;
- classe «Prosper Stars & Stripes Fund 13» libellée en USD et réservée aux actionnaires fondateurs de Prosper Professional Services S.A. (fermée aux souscriptions depuis le 5 octobre 2015).

Global Macro Fund:

- classe «Global Macro I EUR» libellée en EUR et réservée aux investisseurs institutionnels ;
- classe «Global Macro I USD» libellée en USD et réservée aux investisseurs institutionnels ;
- classe «Global Macro I CHF» libellée en CHF et réservée aux investisseurs institutionnels ;
- classe «Global Macro R GBP» libellée en GBP et destinée à tous types d'investisseurs ;
- classe «Global Macro P EUR» libellée en EUR et destinée à tous types d'investisseurs ;
- classe «Global Macro P USD» libellée en USD et destinée à tous types d'investisseurs ;
- classe «Global Macro P CHF» libellée en CHF et destinée à tous types d'investisseurs.

Plurimi World Equity:

- Classe «S – EUR» libellée en EUR et destinée à tous types d'investisseurs ;
- Classe «S – USD» libellée en USD et destinée à tous types d'investisseurs ;
- Classe «S – GBP» libellée en GBP et destinée à tous types d'investisseurs ;
- Classe «I – EUR» libellée en EUR et réservée aux investisseurs institutionnels ;
- Classe «I – USD» libellée en USD et réservée aux investisseurs institutionnels.

Plurimi World Long Short Equity (lancé le 10/01/25):

- Classe «S – EUR» libellée en EUR et destinée à tous types d'investisseurs ;
- Classe «S – USD» libellée en USD et destinée à tous types d'investisseurs ;
- Classe «S – GBP» libellée en GBP et destinée à tous types d'investisseurs ;
- Classe «I – EUR» libellée en EUR et réservée aux investisseurs institutionnels ;
- Classe «I – USD» libellée en USD et réservée aux investisseurs institutionnels ;
- Classe «I – GBP» libellée en GBP et réservée aux investisseurs institutionnels ;
- Classe «P – EUR» libellée en EUR et destinée à tous types d'investisseurs ;
- Classe «P – USD» libellée en USD et destinée à tous types d'investisseurs ;
- Classe «P – CHF» libellée en CHF et destinée à tous types d'investisseurs.

La valeur nette d'inventaire est déterminée journalièrement pour chacun des compartiments. Elle est calculée sur base des derniers cours connus sur les marchés où les titres détenus en portefeuille sont principalement négociés.

PROSPER FUNDS SICAV

Autres notes aux états financiers

2 - Principales méthodes comptables

2.1 - Présentation des états financiers

Les états financiers de la SICAV sont préparés conformément à la réglementation en vigueur concernant les Organismes de Placement Collectif.

2.2 - Evaluation du portefeuille-titres

Les actions/parts d'OPC seront évaluées sur base de leur dernière valeur nette d'inventaire officielle disponible au jour d'évaluation, ou non officielle si celle-ci est de date plus récente (sur base dans ce cas d'une valeur nette d'inventaire probable, estimée avec prudence et bonne foi par le Conseil d'Administration, ou sur base d'autres sources telles qu'une information du gérant dudit OPC).

L'évaluation des valeurs mobilières (i) cotées ou négociées sur un marché réglementé au sens de la Loi de 2010 ou (ii) négociées sur un autre marché d'un Etat membre de l'UE qui est réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public ou (iii) admises à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un Etat qui ne fait pas partie de l'UE ou négociées sur un autre marché d'un Etat qui ne fait pas partie de l'UE, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public (les trois pouvant également être qualifiés de "Marché Réglementé"), est basée sur le dernier cours de clôture connu au jour d'évaluation et si ces valeurs mobilières sont traitées sur plusieurs marchés, sur base du dernier cours de clôture connu du marché principal de ces valeurs au jour d'évaluation. Si le dernier cours de clôture connu au jour d'évaluation donné n'est pas représentatif, l'évaluation se basera sur la valeur probable de réalisation estimée avec prudence et bonne foi.

Les valeurs mobilières non cotées ou non négociables sur un Marché Réglementé seront évaluées sur base de la valeur probable de réalisation estimée avec prudence et bonne foi.

2.3 - Bénéfices ou pertes net(te)s réalisé(e)s sur ventes de titres

Les bénéfices ou pertes réalisés sur ventes de titres sont calculés sur base du coût moyen des titres vendus.

2.4 - Résultats non réalisés sur portefeuille-titres

Les plus-values et moins-values non réalisées à la fin de l'exercice figurent également dans le résultat des opérations.

Les bénéfices ou pertes de change résultant de contrats de change à terme non échus sont comptabilisés à la date de clôture sur base des taux de change à terme applicables à cette date.

2.5 - Conversion des devises étrangères

Tous les avoirs non exprimés dans la devise du compartiment concerné sont convertis dans la devise du compartiment au taux de change en vigueur à Luxembourg à la date de clôture.

La valeur de l'actif net de la SICAV est égale à la somme des valeurs nettes des différents compartiments convertis en EUR aux taux de change en vigueur à Luxembourg à la date de clôture.

PROSPER FUNDS SICAV

Autres notes aux états financiers

2 - Principales méthodes comptables

2.5 - Conversion des devises étrangères

Voici les principaux taux de change appliqués au 31 décembre 2025:

1 EUR =	1,7612	AUD	1 EUR =	1,6099	CAD	1 EUR =	0,9305	CHF
1 EUR =	7,469	DKK	1 EUR =	0,87315	GBP	1 EUR =	9,1413	HKD
1 EUR =	184,08915	JPY	1 EUR =	21,11605	MXN	1 EUR =	11,8465	NOK
1 EUR =	10,827	SEK	1 EUR =	1,51035	SGD	1 EUR =	1,17445	USD

Pour les titres libellés en devises autres que la devise de la SICAV, le coût d'acquisition est calculé sur base du cours de change en vigueur au jour de l'achat.

2.6 - Evaluation des contrats d'options

La valeur de liquidation des contrats d'options qui ne sont pas négociés sur des Marchés Réglementés équivalra à leur valeur de liquidation nette déterminée conformément aux politiques établies par le Conseil d'Administration, sur une base appliquée de façon cohérente à chaque type de contrat. La valeur de liquidation des contrats d'options négociés sur des Marchés Réglementés sera basée sur le dernier prix disponible de règlement de ces contrats sur les Marchés Réglementés sur lesquels ces contrats d'options sont négociés par la SICAV ; pour autant que si un contrat d'options ne peut pas être liquidé le jour auquel les actifs nets sont évalués, la base qui servira à déterminer la valeur de liquidation de ce contrat sera déterminée par le Conseil d'Administration de façon juste et raisonnable.

La valeur des instruments dérivés options qui sont négociés ou cotés à une bourse de valeurs ou un marché organisé est déterminée suivant leur dernier cours de liquidation connu au 31 décembre 2025 sur la bourse de valeurs ou le marché organisé sur lequel sont traités les dits instruments, étant entendu que si l'un des sus-dits instruments dérivés ne peut être liquidé au jour pris en compte pour déterminer les valeurs applicables, la valeur de cet instrument dérivé ou de ces instruments dérivés sera déterminée de façon prudente et raisonnable par le Conseil d'Administration.

2.7 - Evaluation des contrats de change à terme

La valeur de liquidation des contrats à terme qui ne sont pas négociés sur des Marchés Réglementés équivalra à leur valeur de liquidation nette déterminée conformément aux politiques établies par le Conseil d'Administration, sur une base appliquée de façon cohérente à chaque type de contrat. La valeur de liquidation des contrats à terme négociés sur des Marchés Réglementés sera basée sur le dernier prix disponible de règlement de ces contrats sur les Marchés Réglementés sur lesquels ces contrats à terme sont négociés par la SICAV ; pour autant que si un contrat à terme ne peut pas être liquidé le jour auquel les actifs nets sont évalués, la base qui servira à déterminer la valeur de liquidation de ce contrat sera déterminée par le Conseil d'Administration de façon juste et raisonnable.

La valeur de marché des contrats de change à terme est basée sur le taux de change à terme de la devise sous-jacente le jour de l'évaluation.

Les produits et charges des contrats financiers à terme sont rapportés en résultat de manière symétrique à la prise en compte des produits et charges afférents à l'élément couvert.

2.8 - Evaluation des contrats futures

La valeur des instruments dérivés futures qui sont négociés ou cotés à une bourse de valeurs ou un marché organisé est déterminée suivant leur dernier cours de liquidation connu au 31 décembre 2025 sur la bourse de valeurs ou le marché organisé sur lequel sont traités les dits instruments, étant entendu que si l'un des sus-dits instruments dérivés ne peut être liquidé au jour pris en compte pour déterminer les valeurs applicables, la valeur de cet instrument dérivé ou de ces instruments dérivés sera déterminée de façon prudente et raisonnable par le Conseil d'Administration.

Les futures sont inscrits au hors bilan à des fins de suivis interne et réglementaire mais ne figurent pas parmi les engagements de hors bilan publiés.

2.9 - Evaluation des CFD

La valeur des CFDs est à déterminer par référence à la valeur de marché de l'actif sous-jacent, en tenant compte des coûts inhérents à l'opération. Les bénéfices ou pertes réalisés et non-réalisés sont inclus dans l'état des opérations et dans l'état du patrimoine.

PROSPER FUNDS SICAV

Autres notes aux états financiers

2 - Principales méthodes comptables

2.10 - Investissements croisés

Au 31 décembre 2025, le total des investissements croisés du compartiment GLOBAL MACRO FUND s'élève à 2.628.588,64 EUR, la valeur totale de l'actif consolidée au niveau de la SICAV sans investissements croisés s'élèverait à 480.343.818,20 EUR

Compartiments	Investissements croisés	Montant (en EUR)
GLOBAL MACRO FUND	PROSPER PLURIMI WORLD EQUITY I EUR	526.932,00
GLOBAL MACRO FUND	PROSPER PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY P EUR	545.832,00
GLOBAL MACRO FUND	PROSPER PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY I EUR	1.555.824,64
		2.628.588,64

2.11 - Frais de constitution

Les frais d'établissement sont amortis linéairement sur une période de 5 ans.

3 - Commission de gestion et Société de gestion

En rémunération de ses prestations, la Société de Gestion perçoit de la SICAV une commission annuelle dégressive au taux suivant de :

- 0,15% par an sur la tranche des actifs nets comprise entre 0 et l'équivalent en USD de EUR 50 millions,
- 0,12% par an sur la tranche des actifs nets comprise entre l'équivalent en USD de EUR 50 millions et EUR 100 millions,
- et 0,10% sur la tranche des actifs nets moyens au-delà de l'équivalent en USD de EUR 100 millions, avec un minimum de EUR 15.000,- par an.

Cette commission est payable trimestriellement et calculée sur base des actifs nets moyens du compartiment au cours du trimestre sous revue.

En rémunération de ses prestations de Gestionnaire du risque de change pour le compartiment, la Société de Gestion perçoit de la SICAV une commission annuelle au taux de 0,08% par an pour les classes d'actions libellées en EUR, GBP et en CHF du compartiment. Cette commission est payable trimestriellement et calculée sur base des actifs nets moyens des classes d'actions concernées au cours du trimestre sous revue.

En outre, en rémunération des prestations de gestion et de commercialisation, la Société de Gestion perçoit de la SICAV une commission annuelle, reprise dans le tableau ci-dessous, payable trimestriellement et calculée sur base des actifs nets moyens de chacune des classes d'actions du compartiment au cours du trimestre sous revue.

Compartiment	Classe	Code Isin	Taux effectif
PROSPER STARS AND STRIPES FUND	Class 13	LU0999367112	1,2
	I CHF	LU0723589296	1,4
	I EUR	LU0723588991	1,4
	I USD	LU0723589023	1,4
	P CHF	LU0723589619	2,0
	P EUR	LU0723589379	2,0
	P GBP	LU0999346207	2,0
	P USD	LU0723589536	2,0
	R GBP	LU0999345902	1,4

PROSPER FUNDS SICAV

Autres notes aux états financiers

3 - Commission de gestion et Société de gestion

GLOBAL MACRO FUND	I CHF	LU0927891522	1,2
	I EUR	LU0927891365	1,2
	I USD	LU0927891449	1,2
	P CHF	LU0927892090	2,0
	P EUR	LU0927891878	2,0
	P USD	LU0927891951	2,0
	R GBP	LU0927891878	1,2
PROSPER PLURIMI WORLD EQUITY	I EUR	LU2899629997	1,0
	I USD	LU2899630060	1,0
	S EUR	LU2899629567	0,8
	S GBP	LU2899629641	0,8
	S USD	LU2899629724	0,8
PROSPER PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY (lancé le 10/01/2025)	I EUR	LU2899631894	1,0
	I GBP	LU2899631977	1,0
	I USD	LU2899632199	1,0
	P CHF	LU2899632355	2,0
	P EUR	LU2899632439	2,0
	P USD	LU2899632603	2,0
	S EUR	LU2899631209	1,5
	S GBP	LU2899631381	1,5
	S USD	LU2899631464	1,5

4 - Commissions de performance

La Société de Gestion est en droit de percevoir, sur les actifs nets de la Classe d'actions concernée du compartiment concerné, une commission de performance (la « Commission de performance ») basée sur un modèle dit High Water Mark selon lequel la Commission de performance ne peut être due que sur la base de la réalisation d'un nouveau High Water Mark (telle que défini ci-dessous) au cours de la période de référence de la performance.

La période de référence de la performance, qui est la période à la fin de laquelle les pertes passées peuvent être réinitialisées, correspond à la durée de vie totale de la Classe. Il n'est pas prévu de réinitialiser les pertes passées aux fins du calcul des Commissions de performance.

La Commission de performance est calculée pour chaque Classe d'actions au sein du compartiment, chaque Jour d'évaluation, selon la méthodologie décrite ci-dessous. Le taux de Commission de performance applicable correspond à un pourcentage de la différence entre la Valeur d'inventaire nette par action (la « VNI ») et le High Water Mark (tel que défini ci-dessous) multiplié par le nombre d'actions en circulation le Jour d'évaluation concerné.

La Commission de performance est calculée sur la VNI après déduction de tous les frais et commissions et en incluant les souscriptions, les rachats et les distributions de dividendes depuis la dernière provision de la Commission de performance.

Le taux de Commission de performance applicable est fixé à:

Compartiments	Classe d'actions	Taux
PROSPER STARS AND STRIPES FUND	I CHF, I EUR, I USD, P CHF, P EUR, P GBP, P USD et R GBP	18% par an
	Prosper Stars & Stripes Fund 13	15% par an
GLOBAL MACRO FUND	I CHF, I EUR, I USD, P CHF, P EUR, P USD et R GBP	15% par an
PROSPER PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY (lancé le 10/01/2025)	Pour les classes d'actions : F-USD; F-GBP; I-EUR; I-USD; I-GBP; I-CHF; P-EUR; P-USD; P-GBP; P-CHF; R-EUR; R-USD; R-GBP et R-CHF.	15% par an

PROSPER FUNDS SICAV

Autres notes aux états financiers

4 - Commissions de performance

Le High Water Mark est défini comme la VNI la plus élevée jamais atteinte depuis le lancement de la Classe d'Actions (le « HWM »). Par conséquent, si un Jour d'évaluation quelconque, la VNI dépasse le HWM :

- une Commission de performance est accumulée et payable, et
- un nouveau HWM est établi.

Le HWM sera minoré des éventuels dividendes versés aux Actionnaires de la Classe d'actions concernée.

Le HWM initial correspond à la VNI la plus élevée jamais atteinte précédemment depuis le lancement de la Classe d'actions.

Aucune Commission de performance ne sera payée si la VNI concernée tombe en dessous du HWM et aussi longtemps qu'elle reste en dessous de ce dernier.

La fréquence de cristallisation de la Commission de performance applicable à chaque classe d'action coïncidera avec chaque Jour d'évaluation concerné.

Lorsqu'une Classe d'Actions est clôturée (par exemple en cas de rachat total, de fusion, de liquidation, de transfert), toute Commission de performance accumulée à la date du Jour d'évaluation concerné sera payée à la Société de Gestion.

À la date de résiliation de la Convention cadre de gestion collective de portefeuille avec la Société de Gestion ayant droit à une Commission de performance, toute Commission de performance due à cette date de résiliation sera payée à la Société de Gestion.

En application des orientations ESMA sur les commissions de performance (ESMA34-39-992) et la Circulaire CSSF 20/764, le tableau ci-dessous présente le montant des commissions de performance chargées pour chaque catégorie d'actions concernée ainsi que le pourcentage de ces commissions calculé en fonction de la Valeur Nette d'Inventaire (« VNI ») de la catégorie d'actions. Seules les catégories d'actions pour lesquelles des commissions de performance ont été chargées sont présentées.

Durant la période, les commissions de performance sont les suivantes :

Compartiment	Classe d'actions	Code isin	Devise du compartiment	Montant des commissions de performance au 31/12/2025 (en devise du compartiment)	VNI moyenne de la Classe d'actions (en devise du compartiment)	% de la VNI moyenne de la Classe d'actions	
PROSPER STARS AND STRIPES FUND	I USD	LU0723589023	USD	858.695,91	50.282.930,74	-	
	I CHF	LU0723589296		88.434,47	8.938.768,73	1,71	
	I EUR	LU0723588991		231.841,48	17.133.823,51	0,99	
	P USD	LU0723589536		367.561,27	22.680.724,32	-	
	P CHF	LU0723589619		112.713,20	12.001.130,14	1,35	
	P EUR	LU0723589379		189.806,65	14.958.800,06	-	
	CLASS P GBP	LU0999346207		6.620,62	399.543,98	1,62	
	R GBP	LU0999345902		12.898,28	760.103,24	-	
	Class 13	LU0999367112		3.072,90	202.434,88	1,70	
					1.871.644,78	202.434,88	1,52
GLOBAL MACRO FUND	CLASS I EUR	LU0927891365	EUR	67.100,76	17.046.717,46	-	
	CLASS I USD	LU0927891449		302.867,07	41.991.159,96	0,39	
	CLASS I CHF	LU0927891522		1.973,89	2.312.821,81	0,72	
	CLASS R GBP	LU0927891795		112.810,90	16.505.741,77	-	
	CLASS P EUR	LU0927891878		11.083,63	4.336.718,01	0,09	
	CLASS P USD	LU0927891951		57.478,77	9.944.390,05	-	
	CLASS P CHF	LU0927892090		257,44	2.499.139,31	0,68	
					553.572,46	2.499.139,31	0,26
							0,58
							0,01

PROSPER FUNDS SICAV

Autres notes aux états financiers

4 - Commissions de performance

PROSPER PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY (lancé le 10/01/2025)	CLASSE I EUR	LU2899631894		3.390,38	2.066.021,86	-	1,57
	CLASSE I USD	LU2899631977		107.830,97	5.694.942,63	-	1,89
	CLASSE I GBP	LU2899632199		48.458,14	2.721.355,32	-	1,78
	CLASSE P EUR	LU2899632355	USD	80.696,41	6.484.807,48	-	1,24
	CLASSE P USD	LU2899632439		72.286,79	4.392.370,82	-	1,65
	CLASSE P CHF	LU2899632603		21.085,36	1.909.571,41	-	1,10
				362.748,05			

Les montants de performance du tableau ci-dessus sont ceux accumulés du 1er janvier 2025 au 31 décembre 2025 et ne sont pas nécessairement indicatifs des montants futurs payés pour l'année entière. Le Conseil d'Administration souhaite attirer l'attention des investisseurs sur le fait que cette méthode de calcul de la commission de performance peut entraîner des distorsions entre les évolutions des valeurs nettes d'inventaire par action de chaque classe comparée aux autres.

5 - Commission de banque dépositaire

En rémunération de ses prestations, la Banque Dépositaire reçoit de chacun des compartiments une commission annuelle dégressive au taux annuel suivant de :

- 0,08% par an sur la tranche des actifs nets comprise entre 0 et l'équivalent en USD de EUR 50 millions,
- 0,06% par an sur la tranche des actifs nets comprise entre l'équivalent en USD de EUR 50 millions et EUR 100 millions,
- et 0,05% sur la tranche des actifs nets moyens au-delà de l'équivalent en USD de EUR 100 millions

avec un minimum de EUR 10.000,- par an.

Cette commission est payable trimestriellement et calculée sur base des actifs nets moyens du compartiment au cours du trimestre sous revue.

6 - Commissions d'agent domiciliaire

En rémunération de ses fonctions d'agent domiciliaire, d'agent administratif, d'agent de transfert et teneur de registre de la SICAV, CAIFS. reçoit de la Société de Gestion à charge de la SICAV, les rémunérations suivantes :

- Agent Domiciliaire : Un montant forfaitaire de EUR 10.000,- par an pour la SICAV dans son ensemble, payable trimestriellement.
- Agent Administratif : une commission annuelle dégressive au taux annuel suivant de :
 - 0,06% par an sur la tranche des actifs nets comprise entre 0 et l'équivalent en USD de EUR 50 millions;
 - 0,04% par an sur la tranche des actifs nets comprise entre l'équivalent en USD de EUR 50 millions et EUR 100 millions;
 - et 0,02% sur la tranche des actifs nets moyens au-delà de l'équivalent en USD de EUR 100 millions.

avec un minimum de EUR 30.000,- par an par compartiment.

Cette commission est payable trimestriellement et calculée sur base des actifs nets moyens du compartiment au cours du trimestre sous revue.

- Agent de Transfert et Teneur de Registre: Un montant forfaitaire de EUR 3.000,- par an et par compartiment pour la tenue du registre des actionnaires nominatifs du compartiment, payable trimestriellement. Un montant forfaitaire de EUR 30,- par transaction (souscription / rachat / conversion), payable trimestriellement.

7 - Commission de distribution

En rémunération de ses prestations de distributeur global, Prosper Professional Services S.A. reçoit par ailleurs de la Société de Gestion une commission annuelle au taux convenu entre les parties pour les compartiments. Cette commission est payable trimestriellement et calculée sur base des actifs nets moyens du compartiment concerné au cours du trimestre sous revue.

PROSPER FUNDS SICAV

Autres notes aux états financiers

8 - Frais de transaction

Les frais de transactions comprennent les frais de commission, les frais de règlement et les frais de courtage. Tous les coûts de transaction ne sont pas identifiables séparément. Pour les investissements à revenu fixe, les contrats de change à terme et les autres contrats dérivés, les coûts de transaction sont inclus dans le prix d'achat et de vente de l'investissement. Bien qu'ils ne soient pas identifiables séparément, ces coûts de transaction sont pris en compte dans la performance de chaque compartiment. Les coûts liés à l'impact du marché ne sont pas identifiables séparément.

9 - Taxe d'abonnement

La SICAV est régie par les lois fiscales luxembourgeoises.

En vertu de la législation et des règlements en vigueur actuellement, la SICAV est soumise à Luxembourg à la taxe d'abonnement au taux annuel de 0,05% par an de ses avoirs nets. Le taux est de 0,01% pour les actions des classes réservées aux investisseurs institutionnels. Cette taxe d'abonnement est payable trimestriellement. La taxe d'abonnement n'est pas due sur les quotités d'avoirs nets investis en OPC déjà soumis à l'application de cette taxe.

10 - Collatéral

Au 31 décembre 2025, les compartiments ci-après avaient reçu des sûretés en espèces pour des opérations dérivées dont les détails sont les suivants :

Compartiments	Contrepartie	Type de collatéral	Devise	Montant de collatéral reçu dans la devise du compartiment
PROSPER STARS & STRIPES FUND	DEGROOF	CASH	EUR	1,721.16
GLOBAL MACRO FUND	DEGROOF	CASH	EUR	650,000.00
PLURIMI WORLD LONG SHORT EQUITY	DEGROOF	CASH	EUR	654,000.96

11 - Changement dans la composition du portefeuille-titres

Les statuts, les rapports semestriels et annuels peuvent être obtenus gratuitement au siège social de la SICAV.

12 - Événements significatifs au cours de l'exercice

Dans le cadre de l'acquisition de Degroof Petercam par CA Indosuez Wealth Management, une filiale de Crédit Agricole S.A., une série de restructurations a été mise en œuvre au sein du groupe, y compris la fusion de la Société de Gestion CA Indosuez Wealth (Asset Management), avec Degroof Petercam Asset Services S.A. le 1er juin 2025.

La fusion a été structurée de manière à ce que Degroof Petercam Asset Services S.A. soit absorbée par CA Indosuez Wealth (Asset Management) et, en même temps, change de nom pour devenir CA Indosuez Fund Solutions S.A..

13 - Événement post-clôture

Aucun événement significatif n'est survenu postérieurement à la clôture 31 décembre 2025.

PROSPER FUNDS SICAV

Informations supplémentaires non auditées

Politique de rémunération de CA Indosuez Fund Solutions S.A.* (anciennement DEGROOF PETERCAM ASSET SERVICES)

A) Généralités

CA Indosuez Fund Solutions (« CAIFS ») applique une politique de rémunération qui a été conçue de façon à ne pas encourager les prises de risque inconsidérées. À cet égard, ladite politique intègre, dans son système de gestion des performances, des critères de risque spécifiquement adaptés aux divisions concernées. CAIFS a mis en place toute une série de garde-fous destinés à empêcher le personnel de prendre des risques inconsidérés par rapport au profil d'activité.

La structure de gouvernance de la politique de rémunération ("la Politique") vise à éviter tout conflit d'intérêts en interne. La Politique est établie par le Comité de rémunération et approuvée par le Directoire. La Politique suit un processus rigoureux définissant les principes, l'approbation, la communication, la mise en œuvre, la révision et l'actualisation de la Politique avec l'implication du Directoire, des Ressources Humaines, de l'audit interne et des autres fonctions de contrôle.

Les performances sont évaluées au niveau du Groupe et de CAIFS. Les évaluations individuelles du personnel sont fondées sur la fixation d'objectifs financiers et non financiers déterminés en fonction des spécificités et de la portée de la fonction du collaborateur évalué. Par conséquent, les évaluations individuelles portent sur l'accomplissement ou non par le collaborateur des objectifs qui lui ont été assignés et à apprécier sa création de valeur à long terme. De surcroît, les performances permettent également l'évaluation des compétences commerciales et relationnelles et sont liées aux réalisations individuelles du collaborateur. Les critères pris en compte pour établir la rémunération fixe sont : la complexité des tâches, le niveau de responsabilité, les performances ainsi que les conditions du marché local.

B) Méthodologie

CAIFS est titulaire d'une double licence, puisqu'elle exerce d'une part en qualité de société de gestion conformément au chapitre 15 de la loi du 17 décembre 2010 concernant les organismes de placement collectif, et d'autre part en qualité de gestionnaire de fonds d'investissement alternatifs en vertu de la loi du 12 juillet 2013 relative aux gestionnaires de fonds d'investissement alternatifs ("GFIA").

Dans le cadre de ces deux lois, les responsabilités incombant à CAIFS pour l'exercice de ses deux métiers sont relativement similaires. CAIFS estime pouvoir affirmer à bon droit que son personnel est rémunéré de la même façon pour les tâches relevant de l'administration d'organismes de placement collectif en valeurs mobilières ("OPCVM") et de fonds d'investissement alternatifs ("FIA").

Par conséquent, la rémunération, comme précédemment évoqué, est le rapport entre les actifs sous gestion ("ASG") de tous les OPCVM sous la responsabilité de CAIFS et le total des ASG additionné des Actifs Sous Administration ("ASA"). Sur la base des ASG et ASA calculés au 31 décembre 2025, ce ratio s'élève à 55,90%.

Au 31 décembre 2025, CAIFS, la société de gestion, totalisait 35,559 milliards EUR d'ASG pour les OPCVM.

Afin d'évaluer la proportion de la rémunération du personnel de la société de gestion imputable à l'ensemble des OPCVM gérés, il convient d'appliquer le ratio susmentionné à la rémunération annuelle du personnel concerné.

Afin d'évaluer la proportion de la rémunération du personnel de la société de gestion imputable à cet OPCVM uniquement, il convient d'appliquer à la rémunération annuelle du personnel concerné le ratio découlant du rapport entre les ASG de cet OPCVM et le total des ASG de l'ensemble des OPCVM.

C) Rémunération par catégorie de personnel

Le tableau ci-dessous précise, par catégorie de personnel, comment est allouée la rémunération totale des collaborateurs de la Société de Gestion sur la base des ASG de tous les OPCVM :

Catégorie de personnel	Nombre de bénéficiaires (*)	Rémunération totale (en EUR)	Rémunération fixe versée (en EUR)	Rémunération variable versée (en EUR)
Senior Management (**)	8	1.066.719	604.699	462.020
Personnel identifié (***)	10	694.894	444.135	250.759
Autre personnel	179	6.568.530	5.706.442	862.088
	197	8.330.143	6.755.276	1.574.867

(*) Aucun critère de proportionnalité n'est appliqué

(**) Directoire

(***) Personnel identifié autre que celui reporté dans la catégorie Senior Management

Tous les chiffres se rapportent à l'année 2025

PROSPER FUNDS SICAV

Informations supplémentaires non auditées

Politique de rémunération de CA Indosuez Fund Solutions S.A.* (anciennement DEGROOF PETERCAM ASSET SERVICES)

D) Plus-values (carried interest) versées par les OPCVM

Aucun collaborateur de la Société de Gestion ne reçoit de plus-values en provenance d'un quelconque OPCVM.

E) Revue de la politique de rémunération

- **Résultats des examens sur la revue annuelle par la société de gestion des principes généraux de la politique de rémunération et de leur mise en œuvre :**

La Politique de Rémunération de CAIFS a été revue et mise à jour en 2025. La Politique de Rémunération de CAIFS a été validée par le Directoire le 4 décembre 2025. Aucune irrégularité n'a été identifiée.

- **Modification importante de la politique de rémunération adoptée :**

La revue annuelle de la politique de rémunération n'a pas donné lieu à des modifications importante de la Politique de rémunération.

PROSPER FUNDS SICAV

Informations supplémentaires non auditées

Méthode de détermination du risque global

La SICAV devra veiller à ce que son exposition globale sur instruments financiers dérivés n'excède pas la valeur nette totale de son portefeuille.

L'exposition globale est une mesure conçue pour limiter l'effet de levier généré au niveau de chaque compartiment par l'utilisation d'instruments financiers dérivés. La méthode utilisée pour calculer l'exposition globale de chaque compartiment de la SICAV sera celle des engagements. La méthode des engagements consiste à convertir les positions sur instruments financiers dérivés en positions équivalentes sur les actifs sous-jacents puis à agréger la valeur de marché de ces positions équivalentes.

Le niveau de levier maximal en instruments financiers dérivés en suivant la méthodologie des engagements sera de 100%.

Le risque global concernant des instruments dérivés détenus dans un compartiment peut être aussi calculé en utilisant une approche par la VaR (Value-at-Risk) quand celle – ci est mentionnée dans la politique d'un compartiment donné. Dans un tel cas, l'approche par les engagements ne s'appliquera pas.

Dans le cas où l'approche VaR est appliquée, la Société de Gestion définira pour le compartiment une limite maximale en VaR qui est fonction du profil de risque défini sur base d'une perte maximale pouvant être générée par le portefeuille et estimée pour un horizon temporel et un intervalle de confiance donnée.

La VaR est calculée selon une approche absolue ou relative :

VaR absolue :

La Valeur en Risque absolue d'un Compartiment est calculée en pourcentage de la Valeur liquidative du Compartiment et est mesurée par rapport à une limite absolue de 20% telle que définie par les Directives 10-788 de l'ESMA. La VaR absolue est généralement une méthode adéquate en l'absence d'un portefeuille de référence ou d'un indice de référence identifiable, par exemple pour les fonds à objectif de performance absolue.

VaR relative :

La méthode de la VaR relative est utilisée pour les Compartiments pour lesquels un portefeuille ou indice de référence n'intégrant pas de dérivés et reflétant la stratégie d'investissement poursuivie par le Compartiment a été défini. La VaR relative d'un Compartiment est exprimée sous la forme d'un multiple de la VaR d'un portefeuille ou indice de référence et est limitée à maximum deux fois la VaR dudit portefeuille ou indice de référence. Le portefeuille de référence utilisé dans le cadre de la VaR, tel que modifié en tant que de besoin, peut différer de l'indice de référence mentionné au point 2 «Objectifs et politiques d'investissement, profil de risque et profil des investisseur des différents compartiments», dans la partie risque d'un compartiment donné.

PROSPER FUNDS SICAV

Informations supplémentaires non auditées

Méthode de détermination du risque global

Global Macro Fund :

L'exposition globale du Compartiment est mesurée à l'aide de la méthode de la VaR absolue depuis le 6 octobre 2016.

Les niveaux des limites de la VaR Absolue pour l'exercice du 1er janvier 2025 au 31 décembre 2025 ont été les suivants :

-Niveau minimum :	2,34%
-Niveau maximum :	6,55%
-Moyenne :	4,18%

Le calcul de la VaR se base sur les paramètres suivants :

- Model utilisé:	Historique
- Intervalle de confiance :	99 %
- Période de détention:	20 jours ouvrables
- Série historique des données:	2 ans

La somme de notionnels d'instruments dérivés financiers (effet de levier) utilisés pendant l'exercice financier n'a pas excédé 54,41 %.

Le levier escompté est de 300% de l'actif net du Compartiment. Il se peut toutefois qu'il dépasse sensiblement ce niveau de manière ponctuelle. Le levier correspond à la somme des expositions notionnelles des instruments financiers dérivés utilisés.

PROSPER FUNDS SICAV

Informations supplémentaires non auditées

Informations relatives à SFTR (Securities Financing Transactions Regulation)

Conformément à l'article 13 et à la Section A de l'Annexe du Règlement EU 2015/2365 (ci-après le "Règlement"), la SICAV doit informer les investisseurs de l'utilisation qu'elle fait des opérations de financement sur titres et des contrats d'échange sur rendement global dans le rapport annuel et le rapport semestriel.

A la date des états financiers, la SICAV n'est pas concernée par les exigences de publications SFTR. Aucune opération correspondante n'a été réalisée au cours de la période de référence des états financiers.

PROSPER FUNDS SICAV

Informations supplémentaires non auditées

Informations relatives au règlement SFDR (Sustainable Finance Disclosure Regulation)

Déclaration obligatoire conformément à l'article 7 du règlement (UE) 2020/852 du 18 juin 2020 sur l'établissement d'un cadre visant à favoriser les investissements durables et modifiant le règlement (UE) 2019/2088

La SICAV ne fait pas la promotion de facteurs environnementaux, sociaux ou de gouvernance. Elle ne se fixe pas par ailleurs d'objectif d'investissement durable et les investissements sous-jacents à cette SICAV ne prennent pas en compte les critères de l'Union européenne en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental. La SICAV est donc catégorisée « article 6 » du règlement européen dit Sustainable Finance Disclosure (SFDR).