



تدبير الوفاء  
Wafa Gestion

# REPORTING MENSUEL

## FCP CAP INSTITUTIONS

22/05/2026

Valeur liquidative

684 066.51

Actif net

1 794 635 490.40

Nombre de parts

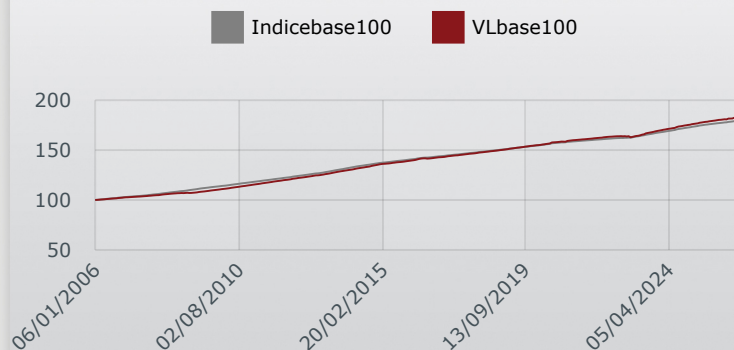
2 623.48

### OBJECTIF ET STRATÉGIE D'INVESTISSEMENT

Le FCP investira son actif à hauteur de 90% minimum hors titres d'opcvn OCT, créances représentatives des opérations de pension qu'il effectue en tant que cessionnaire, en titres de créances, le FCP peut investir à 10% maximum dans des OMLT ou des opérations de placement en devises à l'étranger avec possibilité d'investir dans des oblig perpétuelles.



### EVOLUTION DE LA VALEUR LIQUIDATIVE

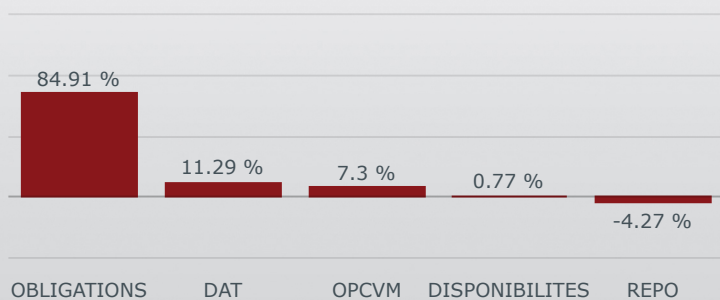


### RÉPARTITION PAR MATURITÉ RÉSIDUELLE

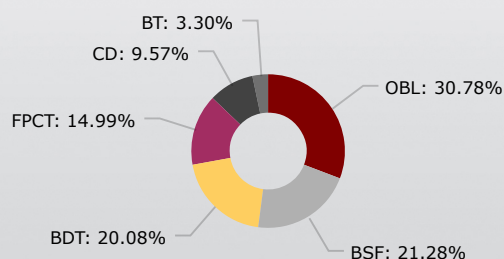
[0\_13s[  
[13s\_26s[  
[26s\_52s[  
[1ans\_2ans[  
[2ans\_3,5ans[  
Cash  
DAT  
OBL  
OPC



### ALLOCATION D'ACTIFS



### RÉPARTITION PAR PRODUIT DE TAUX



### PERFORMANCES

| Performances cumulées    | 1 mois | 6 mois | 1 an  | 2 ans | 3 ans  |
|--------------------------|--------|--------|-------|-------|--------|
| FONDS                    | 0.16%  | 1.28%  | 2.47% | 6.11% | 10.32% |
| BENCH                    | 0.19%  | 1.18%  | 2.21% | 5.47% | 8.89%  |
| Performances annualisées | 1 mois | 6 mois | 1 an  | 2 ans | 3 ans  |
| FONDS                    | 2.11%  | 2.57%  | 2.47% | 3.06% | 3.45%  |
| BENCH                    | 2.43%  | 2.37%  | 2.22% | 2.74% | 2.98%  |



### INDICATEURS TECHNIQUES

|             | FONDS   | BENCH   |
|-------------|---------|---------|
| Sensibilité | 0.96    | 0.52    |
| Duration    | 0.99    | 0.536   |
| Rendement   | 2.8715% | 2.2891% |



تدبير الوفاء  
Wafa Gestion

# REPORTING MENSUEL

## FCP CAP INSTITUTIONS

22/05/2026

### Allocation d'Actifs

| Catégorie               | Montant         | Poids   |
|-------------------------|-----------------|---------|
| BDT                     | 305 940 026,15  | 17,05 % |
| OBLIGATIONS_Garantie    | 0,0             | 0,0 %   |
| OBLIGATIONS_NonGarantie | 697 437 337,76  | 38,86 % |
| CD                      | 145 873 875,2   | 8,13 %  |
| BSF                     | 324 225 066,85  | 18,07 % |
| BT                      | 50 278 625,0    | 2,8 %   |
| OPCVM                   | 131 058 629,87  | 7,3 %   |
| DAT                     | 202 692 794,52  | 11,29 % |
| Autres                  | 13 582 778,11   | 0,76 %  |
| Disponibilités+Repo     | -76 433 132,96  | -4,26 % |
| Total Actif             | 1 794 656 000,5 | 100,0 % |

### Repartition de la dette privées

| Emetteur                    | Garantie | Montant        | Poids   |
|-----------------------------|----------|----------------|---------|
| AGENCE NATIONAL DES PORTS   | N        | 4 243 870,33   | 0,24 %  |
| ATTIJARIWafa BANK           | N        | 248 575 712,56 | 13,85 % |
| BCP                         | N        | 102 726 576,25 | 5,72 %  |
| BMCE                        | N        | 46 496 307,8   | 2,59 %  |
| CDM                         | N        | 54 644 347,75  | 3,04 %  |
| EQDOM                       | N        | 31 454 202,4   | 1,75 %  |
| FONDS D'EQUIPEMENT COMMUNAL | N        | 27 431 614,57  | 1,53 %  |
| MAGHREBAIL                  | N        | 13 346 057,5   | 0,74 %  |
| MANAGEM                     | N        | 50 278 625,0   | 2,8 %   |
| MAROC TELECOM               | N        | 130 801 510,4  | 7,29 %  |
| RCI FINANCE                 | N        | 12 078 969,6   | 0,67 %  |
| SOFA CREDIT                 | N        | 11 876 473,0   | 0,66 %  |
| SOGLEASE                    | N        | 13 286 826,8   | 0,74 %  |
| Wafa BAIL                   | N        | 68 351 825,95  | 3,81 %  |
| Wafa SALAF                  | N        | 148 731 171,6  | 8,29 %  |

TOTAL

964 324 091,51

53,73 %