

R-co Valor Bond Opportunities

Compartiment de la SICAV :

R-CO

29, avenue de Messine
75008 Paris

Attestation du Commissaire aux Comptes relative à la composition de l'actif

au 30 juin 2023

R-co Valor Bond Opportunities

Compartiment de la SICAV :

R-CO

29, avenue de Messine
75008 Paris

Attestation du Commissaire aux Comptes relative à la composition de l'actif

au 30 juin 2023

En notre qualité de commissaire aux comptes de la SICAV R-CO et en application des dispositions prévues par l'article L 214-17 du Code monétaire et financier relatives au contrôle de la composition de l'actif, nous avons établi la présente attestation sur les informations figurant dans la composition de l'actif du compartiment R-co Valor Bond Opportunities au 30 juin 2023 ci-jointe.

Ces informations ont été établies sous la responsabilité de la SICAV. Il nous appartient de nous prononcer sur la cohérence des informations contenues dans la composition de l'actif avec la connaissance que nous avons de l'OPC acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Nous avons mis en œuvre les diligences que nous avons estimé nécessaires au regard de la doctrine professionnelle de la Compagnie nationale des commissaires aux comptes relative à cette mission. Ces diligences, qui ne constituent ni un audit ni un examen limité, ont consisté essentiellement à réaliser des procédures analytiques et des entretiens avec les personnes qui produisent et contrôlent les informations données.

Sur la base de nos travaux, nous n'avons pas d'observation à formuler sur la cohérence des informations figurant dans le document joint avec la connaissance que nous avons de l'OPC acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

A Paris La Défense, le 13 septembre 2023

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés


Olivier GALIENNE

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 640068 R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

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

I - Obligations & Valeurs assimilées

Obligations & valeurs assimilées négociés sur un marché réglementé

Obligations à taux fixe nég. sur un marché regl.

DEVISE VALEUR : EUR EURO

ES0365936048	ABAN CO 5. 5 05-26	(366) 180526	3,500,000.	M EUR	99.8629	% 30/06/23	99.443	4	3,495,200.00	3,505,224.95	24,719.95	10,024.95	0.94
ES0865936019	ABAN CO 6. 0 PERP	(UST) 311299	1,000,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	86.456	4	1,000,000.00	876,922.64	12,362.64	-123,077.36	0.23
XS2613658470	ABN AMR 3. 75 04-25	(366) 200425	3,400,000.	M EUR	99.896	% 30/06/23	99.158	4	3,396,464.00	3,397,499.05	26,127.05	1,035.05	0.91
DE000A254YS5	ACCE RE 3. 625 02-26	(UST) 130226	3,500,000.	M EUR	71.405	% 30/06/23	60.649	4	2,249,256.57	1,979,458.52	69,015.02	-269,798.05	0.53
XS2351301499	ACEF HO 0. 75 06-28	(366) 140628	1,150,000.	M EUR	99.364	% 30/06/23	81.867	4	1,142,686.00	941,941.81	471.31	-200,744.19	0.25
BE6325355822	AGEA NV 1. 875 11-51	(366) 241151	1,300,000.	M EUR	99.626	% 30/06/23	72.8995	4	1,295,138.00	962,518.84	14,825.34	-332,619.16	0.26
BE6317598850	AGEAS NV 3. 875 PERP	(366) 311299	2,000,000.	M EUR	104.0402	% 30/06/23	72.449	4	2,080,804.38	1,454,061.97	5,081.97	-626,742.41	0.39
XS2230399441	AIB GRO 2. 875 05-31	(366) 300531	1,400,000.	M EUR	99.952	% 30/06/23	90.8095	4	1,399,328.00	1,275,182.04	3,849.04	-124,145.96	0.34
FR0013477254	AIR FR 1. 875 01-25	(366) 160125	3,000,000.	M EUR	91.6198	% 30/06/23	94.0365	4	2,748,594.24	2,847,139.52	26,044.52	98,545.28	0.76
FR001400F2R8	AIR FR 8. 125 05-28	(366) 310528	2,100,000.	M EUR	99.547	% 30/06/23	103.76	4	2,090,487.00	2,194,810.41	15,850.41	104,323.41	0.59
XS2342910689	ALAI AF 4. 25 05-26	(EUR) 190526	1,000,000.	M EUR	100.2353	% 30/06/23	96.049	4	1,002,352.94	965,802.50	5,312.50	-36,550.44	0.26
BE6331562817	ALIA FI 0. 875 11-28	(366) 081128	2,000,000.	M EUR	99.213	% 30/06/23	79.887	4	1,984,260.00	1,609,150.96	11,410.96	-375,109.04	0.43
FR0013453974	ALTA CO 1. 875 01-28	(366) 170128	600,000.	M EUR	99.241	% 30/06/23	80.9185	4	595,446.00	490,689.08	5,178.08	-104,756.92	0.13
XS2331921390	ANIMA 1. 5 04-28	(366) 220428	1,100,000.	M EUR	99.408	% 30/06/23	85.2915	4	1,093,488.00	941,497.48	3,290.98	-151,990.52	0.25
FR0013455862	APIC PR 4. 0 10-29	(366) 241029	600,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	89.722	4	600,000.00	554,967.62	16,635.62	-45,032.38	0.15
XS2338530467	ATRI EU 3. 625 PERP	(366) 311299	2,000,000.	M EUR	98.1942	% 30/06/23	34.458	4	1,963,884.00	737,228.49	48,068.49	-1,226,655.51	0.20
XS2294495838	ATRI FI 2. 625 09-27	(366) 050927	1,650,000.	M EUR	94.1741	% 30/06/23	72.9295	4	1,553,873.17	1,239,173.39	35,836.64	-314,699.78	0.33
XS2267889991	AUTO PE 2. 0 12-28	(366) 041228	4,500,000.	M EUR	98.1208	% 30/06/23	87.6115	4	4,415,434.94	3,994,791.47	52,273.97	-420,643.47	1.07
XS2434421413	BANC BP 3. 375 01-32	(366) 190132	4,000,000.	M EUR	99.521	% 30/06/23	87.486	4	3,980,840.00	3,560,837.26	61,397.26	-420,002.74	0.95
XS2284323347	BANC BP 6. 5 PERP	(UST) 311299	500,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	91.25	4	500,000.00	471,153.31	14,903.31	-28,846.69	0.13
XS2471862040	BANC DE 9. 375 PERP	(UST) 311299	3,000,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	97.294	4	3,000,000.00	2,978,315.19	59,495.19	-21,684.81	0.80
XS1700435453	BANC IF 4. 5 10-27	(366) 171027	900,000.	M EUR	80.8533	% 30/06/23	97.3215	4	727,679.51	904,742.82	28,849.32	177,063.31	0.24
XS2577518488	BANC IF 6. 125 01-27	(366) 190127	2,000,000.	M EUR	99.569	% 30/06/23	100.155	4	1,991,380.00	2,058,812.33	55,712.33	67,432.33	0.55
XS2626699982	BANC NT 5. 75 08-33	(366) 230833	5,000,000.	M EUR	99.7002	% 30/06/23	99.399	4	4,985,010.00	5,003,032.19	33,082.19	18,022.19	1.34
XS2342592297	BANQ IN 1. 75 08-31	(366) 180831	1,100,000.	M EUR	99.789	% 30/06/23	88.5675	E	1,097,679.00	991,119.21	16,876.71	-106,559.79	0.26
XS2077670003	BAYER 2. 375 11-79	(366) 121179	600,000.	M EUR	99.857	% 30/06/23	93.115	4	599,142.00	560,753.52	2,063.52	-38,388.48	0.15
ES0813211002	BBVA 5. 875 PERP	(UST) 311299	1,600,000.	M EUR	108.4713	% 30/06/23	99.2435	4	1,735,541.48	1,590,450.35	2,554.35	-145,091.13	0.42
PTBCPBOM0062	BCP 8. 5 10-25	(366) 271025	2,000,000.	M EUR	100.22	% 30/06/23	103.506	4	2,004,400.00	2,187,489.86	117,369.86	183,089.86	0.58
XS2133056114	BERK HA 0. 0 03-25	(366) 120325	5,000,000.	M EUR	93.458	% 30/06/23	93.6415	4	4,672,900.00	4,682,075.00	0.00	9,175.00	1.25
XS2404266848	BFF BAN 5. 875 PERP	(UST) 311299	1,800,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	84.9205	4	1,800,000.00	1,577,062.09	48,493.09	-222,937.91	0.42
XS2340236327	BK IREL 1. 375 08-31	(366) 110831	850,000.	M EUR	99.951	% 30/06/23	86.97	4	849,583.50	749,715.72	10,470.72	-99,867.78	0.20
XS2065555562	BK IREL 2. 375 10-29	(366) 141029	500,000.	M EUR	99.972	% 30/06/23	95.4895	4	499,860.00	486,004.01	8,556.51	-13,855.99	0.13
XS2338167104	BK LC L 5. 25 04-29	(EUR) 300429	600,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	94.358	4	600,000.00	571,748.00	5,600.00	-28,252.00	0.15
XS2247718435	BLAC PR 1. 25 04-27	(366) 260427	3,000,000.	M EUR	89.4185	% 30/06/23	79.995	4	2,682,554.79	2,406,919.67	7,069.67	-275,635.12	0.64
FR001400BBL2	BNP PAR 6. 875 PERP	(UST) 311299	3,200,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	96.173	4	3,200,000.00	3,094,366.60	16,830.60	-105,633.40	0.83
XS2193661324	BP CAP 3. 25 PERP	(366) 311299	950,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	92.466	4	950,000.00	879,439.30	1,012.30	-70,560.70	0.23
FR0014005V34	BPCE 1. 5 01-42	(366) 130142	2,000,000.	M EUR	99.7602	% 30/06/23	84.351	4	1,995,204.00	1,701,156.99	14,136.99	-294,047.01	0.45
FR001400HACO	BPCE 3. 625 04-26	(366) 170426	2,800,000.	M EUR	99.64	% 30/06/23	98.4375	E	2,789,920.00	2,777,881.15	21,631.15	-12,038.85	0.74
FR0014005090	BQ POST 3. 0 PERP	(UST) 311299	3,000,000.	M EUR	66.6413	% 30/06/23	66.3855	4	1,999,239.13	2,002,570.43	11,005.43	3,331.30	0.53
XS2391779134	BRIT AM 3. 0 PERP	(366) 311299	3,000,000.	M EUR	84.4475	% 30/06/23	84.087	4	2,533,424.66	2,569,212.74	46,602.74	35,788.08	0.69
FR001400F067	CA 7. 25 PERP	(UST) 311299	1,900,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	99.7365	4	1,900,000.00	1,899,111.03	4,117.53	-888.97	0.51
ES0840609038	CAIX 3. 625 PERP	(UST) 311299	1,000,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	68.238	4	1,000,000.00	684,350.11	1,970.11	-315,649.89	0.18
PTCCMOM0006	CAIX CE 8. 375 07-27	(366) 040727	2,300,000.	M EUR	99.681	% 30/06/23	100.16	E	2,292,663.00	2,303,680.00	0.00	11,017.00	0.61

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 640068 R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<-----> PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	<-----> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
XS2264155305	CARN CO 7.625 03-26	(EUR) 010326	3,000,000.	M EUR	98.7014	% 30/06/23	97.2985	4	2,961,041.67	2,997,111.25	78,156.25	36,069.58	0.80
XS1401331753	CARR 0.75 04-24	(366) 260424	4,000,000.	M EUR	97.9945	% 30/06/23	97.5015	4	3,919,780.82	3,905,715.74	5,655.74	-14,065.08	1.04
XS2585964476	CASS CE 5.885 02-27	(366) 160227	2,850,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	100.2025	4	2,850,000.00	2,919,184.14	63,412.89	69,184.14	0.78
XS2380124227	CAST AB 3.125 PERP	(366) 311299	2,000,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	70.7475	4	2,000,000.00	1,436,124.86	21,174.86	-563,875.14	0.38
FR0013523891	CCR RE 2.875 07-40	(366) 150740	300,000.	M EUR	99.529	% 30/06/23	79.6875	4	298,587.00	247,427.57	8,365.07	-51,159.43	0.07
XS1811024543	CE ENER 1.659 04-24	(366) 260424	3,500,000.	M EUR	88.1547	% 30/06/23	95.389	4	3,085,415.42	3,349,561.68	10,946.68	264,146.26	0.89
XS2356316872	CECO AG 1.75 06-26	(366) 240626	5,000,000.	M EUR	62.4211	% 30/06/23	78.5515	4	3,121,054.79	3,929,965.71	2,390.71	808,910.92	1.05
XS2497520705	CELA US 4.777 07-26	(366) 190726	2,150,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	97.697	4	2,150,000.00	2,198,970.23	98,484.73	48,970.23	0.59
XS2300292963	CELL FI 1.25 01-29	(366) 150129	1,100,000.	M EUR	98.582	% 30/06/23	83.0295	4	1,084,402.00	919,728.61	6,404.11	-164,673.39	0.25
XS2638560156	CESK SP 5.943 06-27	(366) 290627	2,400,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	100.0925	4	2,400,000.00	2,404,168.52	1,948.52	4,168.52	0.64
XS2468979302	CETI FI 3.125 04-27	(366) 140427	2,800,000.	M EUR	99.495	% 30/06/23	92.557	4	2,785,860.00	2,610,960.75	19,364.75	-174,899.25	0.70
XS2347397437	CITY OY 3.625 PERP	(366) 311299	1,500,000.	M EUR	98.495	% 30/06/23	53.087	4	1,477,425.00	840,549.86	44,244.86	-636,875.14	0.22
XS2079413527	CITY OY 4.496 PERP	(366) 311299	300,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	65.127	4	300,000.00	200,258.85	4,877.85	-99,741.15	0.05
XS2310411090	CITY TR 1.625 03-28	(366) 120328	850,000.	M EUR	98.898	% 30/06/23	73.097	4	840,633.00	625,626.75	4,302.25	-215,006.25	0.17
DE000CZ45W81	CMZB FR 6.5 12-32	(366) 061232	1,500,000.	M EUR	99.778	% 30/06/23	99.497	4	1,496,670.00	1,548,550.89	56,095.89	51,880.89	0.41
XS2202900424	COOP RA 4.375 PERP	(UST) 311299	1,200,000.	M EUR	96.3207	% 30/06/23	87.5375	4	1,155,848.08	1,051,167.21	717.21	-104,680.87	0.28
XS2456432413	COOP RA 4.875 PERP	(UST) 311299	1,000,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	84.1825	4	1,000,000.00	842,490.98	665.98	-157,509.02	0.22
XS2621757405	CORN 3.875 05-26	(366) 150526	3,650,000.	M EUR	99.986	% 30/06/23	98.8955	4	3,649,489.00	3,629,007.81	19,322.06	-20,481.19	0.97
FR0014001186	CRED MU 3.875 05-28	(366) 220528	2,500,000.	M EUR	99.862	% 30/06/23	99.3155	E	2,496,550.00	2,494,268.99	11,381.49	-2,281.01	0.67
XS2589907653	CRED SU 5.5 08-26	(366) 200826	4,000,000.	M EUR	99.708	% 30/06/23	101.6935	4	3,988,320.00	4,148,507.12	80,767.12	160,187.12	1.11
BE0002872530	CRELAN 5.375 10-25	(366) 311025	3,200,000.	M EUR	99.707	% 30/06/23	99.545	E	3,190,624.00	3,301,363.29	115,923.29	110,739.29	0.88
XS2336345140	CT INVE 5.5 04-26	(EUR) 150426	1,000,000.	M EUR	100.6741	% 30/06/23	93.282	4	1,006,741.02	944,889.44	12,069.44	-61,851.58	0.25
DE000A3LBM2	DAIM CA 3.0 02-27	(366) 230227	2,500,000.	M EUR	99.2577	% 30/06/23	97.3975	4	2,481,441.78	2,461,855.31	26,917.81	-19,586.47	0.66
SE0015797683	DDM DEB 9.0 04-26	(EUR) 190426	2,200,000.	M EUR	101.0545	% 30/06/23	69.4565	E	2,223,200.00	1,569,293.00	41,250.00	-653,907.00	0.42
XS2363244513	DEUT LU 2.0 07-24	(366) 140724	2,000,000.	M EUR	99.283	% 30/06/23	97.67	4	1,985,660.00	1,992,304.11	38,904.11	6,644.11	0.53
XS1808862657	DEUT PF 5.75 PERP	(366) 311299	1,600,000.	M EUR	96.3031	% 30/06/23	68.9005	4	1,540,849.32	1,119,249.53	16,841.53	-421,599.79	0.30
XS2306601746	EASY FI 1.875 03-28	(366) 030328	2,600,000.	M EUR	91.424	% 30/06/23	87.4845	4	2,377,023.97	2,290,980.20	16,383.20	-86,043.77	0.61
FR0014003556	EDF 2.625 PERP	(366) 311299	4,000,000.	M EUR	99.1115	% 30/06/23	80.942	4	3,964,461.65	3,247,147.21	9,467.21	-717,314.44	0.87
FR0013367612	EDF 4.0 PERP	(366) 311299	1,000,000.	M EUR	110.0574	% 30/06/23	97.3	4	1,100,574.21	1,002,917.81	29,917.81	-97,656.40	0.27
XS2423013742	EDRE OD 5.5 07-27	(EUR) 150727	1,500,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	91.3485	4	1,500,000.00	1,408,956.67	38,729.17	-91,043.33	0.38
XS2065633203	EG GLOB 6.25 10-25	(EUR) 301025	1,000,000.	M EUR	102.5778	% 30/06/23	95.371	4	1,025,777.64	964,821.11	11,111.11	-60,956.53	0.26
XS2576550086	ENEL 6.375 PERP	(366) 311299	1,100,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	100.886	4	1,100,000.00	1,142,214.84	32,468.84	42,214.84	0.30
XS2334852253	ENI 2.0 PERP	(366) 311299	2,150,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	85.069	4	2,150,000.00	1,835,327.76	6,344.26	-314,672.24	0.49
XS2242929532	ENI 2.625 PERP	(366) 311299	900,000.	M EUR	99.403	% 30/06/23	92.374	4	894,627.00	842,498.88	11,132.88	-52,128.12	0.22
FR0013461274	ERAMET 5.875 05-25	(366) 210525	1,300,000.	M EUR	100.0945	% 30/06/23	102.041	4	1,301,228.77	1,335,714.69	9,181.69	34,485.92	0.36
FR0011926252	ERAMET S. FIX 280526	(366) 280526	2,000,000.	M EUR	97.2945	% 30/06/23	96.931	E	1,945,890.41	1,948,931.48	10,311.48	3,041.07	0.52
XS1716927766	FERR NE 2.124 PERP	(366) 311299	3,800,000.	M EUR	83.6864	% 30/06/23	99.663	4	3,180,084.66	3,798,440.75	11,246.75	618,356.09	1.01
FI4000507132	FINNNAIR 4.25 05-25	(EUR) 190525	2,000,000.	M EUR	99.716	% 30/06/23	93.6405	4	1,994,320.00	1,883,435.00	10,625.00	-110,885.00	0.50
PTGGDDMO008	GALP GA 4.875 07-28	(366) 030728	3,000,000.	M EUR	99.8	% 30/06/23	100.024	E	2,994,000.00	3,001,119.59	399.59	7,119.59	0.80
XS2321537255	GAMM BI 5.125 07-25	(EUR) 150725	1,000,000.	M EUR	101.7396	% 30/06/23	101.3115	4	1,017,396.11	1,037,174.03	24,059.03	19,777.92	0.28
BE0002595735	GBLB 1 7/8 06/19/2	(EXA) 190625	2,000,000.	M EUR	98.2589	% 30/06/23	95.798	4	1,965,178.08	1,917,599.34	1,639.34	-47,578.74	0.51
XS0816246077	GE 3.65 08/23/32	(EXA) 230832	1,500,000.	M EUR	126.92	% 30/06/23	97.5425	E	1,903,800.00	1,510,387.50	47,250.00	-393,412.50	0.40
XS2247623643	GETLINK 3.5 10-25	(USA) 301025	600,000.	M EUR	103.1954	% 30/06/23	97.9325	4	619,172.13	587,828.33	233.33	-31,343.80	0.16
XS2078696866	GREN FI 0.625 01-25	(366) 090125	2,000,000.	M EUR	89.0082	% 30/06/23	90.76	4	1,780,164.38	1,821,227.40	6,027.40	41,063.02	0.49
XS2155486942	GREN FI 3.95 07-25	(366) 090725	1,950,000.	M EUR	105.9409	% 30/06/23	95.66	4	2,065,847.36	1,941,339.86	75,969.86	-124,507.50	0.52
XS2469031749	GREN FI 4.125 10-24	(366) 141024	950,000.	M EUR	99.73	% 30/06/23	98.083	4	947,435.00	960,024.97	28,236.47	12,589.97	0.26
DE000HCB0BS6	HAMB CO 4.875 03-25	(366) 170325	4,200,000.	M EUR	99.948	% 30/06/23	99.6375	4	4,197,816.00	4,245,752.46	60,977.46	47,936.46	1.13
XS2607183980	HARL DA 5.125 04-26	(366) 050426	2,500,000.	M EUR	100.0373	% 30/06/23	100.952	4	2,500,933.33	2,555,306.15	31,506.15	54,372.82	0.68

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 640068 R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P. R. U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	Devise du portefeuille				PRCT ACT NET
									<-----> PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	>-----> PLUS OU MOINS VAL	
SE0015657903	HEIM AB 4.25 03-26	(EUR) 090326	1,400,000.	M EUR	87.8719	% 30/06/23	54.4255	4	1,230,206.89	780,963.94	19,006.94	-449,242.95	0.21
SE0016589105	HEIM AB 4.375 03-27	(EUR) 060327	2,000,000.	M EUR	99.397	% 30/06/23	65.168	4	1,987,940.00	1,332,040.56	28,680.56	-655,899.44	0.36
SE0016278352	HEIM AB 6.75 PERP	(366) 311299	900,000.	M EUR	99.895	% 30/06/23	43.0055	4	899,055.00	415,344.02	28,294.52	-483,710.98	0.11
XS2263659158	HOIST FINANCE AB	(366) 271124	600,000.	M EUR	105.9976	% 30/06/23	93.744	E	635,985.62	574,614.00	12,150.00	-61,371.62	0.15
XS2608828641	HOLD D 4.5 04-27	(366) 060427	1,600,000.	M EUR	99.603	% 30/06/23	98.6395	4	1,593,648.00	1,595,740.20	17,508.20	2,092.20	0.43
XS2397781357	ILIA HO 5.125 10-26	(EUR) 151026	1,500,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	95.818	4	1,500,000.00	1,454,139.79	16,869.79	-45,860.21	0.39
FR0013331196	ILIA D 1.875 04-25	(366) 250425	1,500,000.	M EUR	97.0654	% 30/06/23	94.8485	4	1,455,981.16	1,428,106.60	5,379.10	-27,874.56	0.38
XS2587104444	IM GROU 8.0 03-28	(EUR) 010328	2,300,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	88.9485	4	2,300,000.00	2,113,793.28	67,977.78	-186,206.72	0.56
XS2243564478	IMMO AG 2.5 10-27	(366) 151027	600,000.	M EUR	97.856	% 30/06/23	81.202	4	587,136.00	497,979.12	10,767.12	-89,156.88	0.13
XS2244936659	INFR WI 1.625 10-28	(366) 201028	850,000.	M EUR	99.755	% 30/06/23	88.137	4	847,917.50	758,852.17	9,687.67	-89,065.33	0.20
XS2463450408	INTE 6.375 PERP	(UST) 311299	1,400,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	86.9865	4	1,400,000.00	1,241,093.61	23,282.61	-158,906.39	0.33
XS2256977013	INTL PE 9.75 11-25	(366) 121125	2,000,000.	M EUR	75.2279	% 30/06/23	89.049	E	1,504,558.68	1,905,993.70	125,013.70	401,435.02	0.51
XS2034925375	INTR AB 3.5 07-26	(EUR) 150726	1,000,000.	M EUR	104.0747	% 30/06/23	74.5605	4	1,040,747.22	762,035.56	16,430.56	-278,711.66	0.20
XS2566291865	INTR AB 9.25 03-28	(UST) 150328	2,800,000.	M EUR	97.9857	% 30/06/23	84.7605	4	2,743,600.00	2,451,416.28	78,122.28	-292,183.72	0.65
XS2010037849	JAGU LA 5.875 11-24	(EUR) 151124	2,500,000.	M EUR	97.1713	% 30/06/23	100.4055	4	2,429,281.25	2,530,128.82	19,991.32	100,847.57	0.68
XS2586873379	JULI BA 6.625 PERP	(UST) 311299	1,000,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	86.9875	4	1,000,000.00	895,313.54	25,438.54	-104,686.46	0.24
XS1605600532	LA FINA 4.0 05-24	(EUR) 150524	2,600,000.	M EUR	83.7768	% 30/06/23	74.6385	4	2,178,197.77	1,954,756.56	14,155.56	-223,441.21	0.52
XS2363989273	LAR ESP 1.75 07-26	(366) 220726	1,000,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	84.498	4	1,000,000.00	861,616.99	16,636.99	-138,383.01	0.23
XS2536848448	LOTT 9.75 09-27	(EUR) 300927	3,100,000.	M EUR	102.5746	% 30/06/23	108.291	4	3,179,812.50	3,498,910.58	141,889.58	319,098.08	0.93
ES0224244105	MAPFRE 2.875 04-30	(366) 130430	2,000,000.	M EUR	99.06	% 30/06/23	86.1375	4	1,981,200.00	1,735,632.51	12,882.51	-245,567.49	0.46
XS2388876232	MBANK 0.966 09-27	(366) 210927	1,300,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	78.233	4	1,300,000.00	1,026,868.97	9,839.97	-273,131.03	0.27
FR0014008J04	MERC 2.5 02-29	(366) 280229	2,000,000.	M EUR	99.399	% 30/06/23	81.924	4	1,987,980.00	1,655,693.11	17,213.11	-332,286.89	0.44
XS2402071760	MIDC GB 7.75 11-27	(EUR) 011127	1,700,000.	M EUR	100.7059	% 30/06/23	94.173	4	1,712,000.00	1,623,997.25	23,056.25	-88,002.75	0.43
FR0014003Y09	MUTU AS 0.625 06-27	(366) 210627	1,500,000.	M EUR	89.2902	% 30/06/23	85.524	4	1,339,353.08	1,283,192.99	332.99	-56,160.09	0.34
FR0014003XY0	MUTU AS 3.5 PERP	(UST) 311299	2,000,000.	M EUR	101.3054	% 30/06/23	71.976	4	2,026,108.34	1,442,006.34	2,486.34	-584,102.00	0.38
XS2203802462	NE PROP 3.375 07-27	(366) 140727	1,400,000.	M EUR	100.8822	% 30/06/23	89.905	4	1,412,350.68	1,304,625.48	45,955.48	-107,725.20	0.35
XS2362994068	NEMA SA 2.25 07-28	(366) 200728	2,700,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	81.3235	4	2,700,000.00	2,253,821.49	58,086.99	-446,178.51	0.60
XS1691468026	NI BC BA 6.0 PERP	(UST) 311299	500,000.	M EUR	92.75	% 30/06/23	77.748	4	463,750.00	395,297.38	6,557.38	-68,452.62	0.11
XS2430442868	NOVA KR 1.875 01-25	(366) 270125	2,200,000.	M EUR	99.92	% 30/06/23	96.8045	E	2,198,240.00	2,147,555.16	17,856.16	-50,684.84	0.57
XS2498964209	NOVA LJ 6.0 07-25	(366) 190725	2,000,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	99.9215	4	2,000,000.00	2,113,498.49	115,068.49	113,498.49	0.56
PTNOBI0M0014	NOVO BA 3.5 07-24	(366) 230724	2,500,000.	M EUR	99.6507	% 30/06/23	99.8165	4	2,491,267.12	2,578,357.71	82,945.21	87,090.59	0.69
PTNOBLOM0001	NOVO BA 9.875 12-33	(366) 011233	4,700,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	103.233	4	4,700,000.00	4,893,912.99	41,961.99	193,912.99	1.31
XS2022093434	OMV AG 0.0 07-25	(366) 030725	4,000,000.	M EUR	92.501	% 30/06/23	92.54	4	3,700,040.00	3,701,600.00	0.00	1,560.00	0.99
FR0013322187	ORPEA 2.625 03-25	(366) 100325	3,000,000.	M EUR	98.1581	% 30/06/23	30.33	4	2,944,741.79	934,859.02	24,959.02	-2,009,882.77	0.25
XS2582358789	PKO BAN 5.625 02-26	(366) 010226	2,250,000.	M EUR	99.9236	% 30/06/23	100.2315	4	2,248,280.00	2,308,260.98	53,052.23	59,980.98	0.62
XS0906815591	PM 2 3/4 03/19/25	(366) 190325	1,800,000.	M EUR	98.2327	% 30/06/23	98.023	4	1,768,187.70	1,778,885.31	14,471.31	10,697.61	0.47
XS2113662063	POS AV 5.375 PERP	(366) 311299	1,800,000.	M EUR	94.7974	% 30/06/23	89.696	4	1,706,352.74	1,653,758.14	39,230.14	-52,594.60	0.44
XS2078976805	PPF ARE 2.125 01-25	(366) 310125	850,000.	M EUR	99.638	% 30/06/23	96.236	4	846,923.00	825,626.89	7,620.89	-21,296.11	0.22
XS2176872849	PPF ARE 3.5 05-24	(366) 200524	350,000.	M EUR	99.634	% 30/06/23	100.002	4	348,719.00	351,513.15	1,506.15	2,794.15	0.09
XS2244811019	QUIN PR 7.5 PERP	(UST) 311299	2,000,000.	M EUR	107.8791	% 30/06/23	86.1235	E	2,157,582.88	1,789,597.07	67,127.07	-367,985.81	0.48
XS2049823763	RAIF BA 1.5 03-30	(366) 120330	1,800,000.	M EUR	93.2749	% 30/06/23	86.1835	4	1,678,948.89	1,559,712.84	8,409.84	-119,236.05	0.42
XS2534786590	RAIF BA 7.375 12-32	(366) 201232	1,000,000.	M EUR	99.48	% 30/06/23	99.4865	4	994,800.00	1,034,467.74	39,602.74	39,667.74	0.28
XS2559379529	RAIF BA 8.75 11-25	(366) 241125	1,700,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	103.226	4	1,700,000.00	1,846,129.67	91,287.67	146,129.67	0.49
XS2291911282	REKEEP 7.25 02-26	(EUR) 010226	1,000,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	94.217	4	1,000,000.00	972,982.50	30,812.50	-27,017.50	0.26
XS2166754957	SCHL FI 1.375 10-26	(366) 281026	4,000,000.	M EUR	93.9564	% 30/06/23	92.759	4	3,758,254.79	3,747,880.55	37,520.55	-10,374.24	1.00
XS2325693369	SCYRSM 3 1/4 04/02/2	(EXA) 020424	1,500,000.	M EUR	100.6617	% 30/06/23	98.7625	E	1,509,925.99	1,494,224.39	12,786.89	-15,701.60	0.40
XS2607381436	SECU TR 4.25 04-27	(366) 040427	2,650,000.	M EUR	99.917	% 30/06/23	99.625	4	2,647,800.50	2,668,064.89	28,002.39	20,264.39	0.71
FR001400F877	SG 7.875 PERP	(UST) 311299	2,000,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	95.9845	4	2,000,000.00	1,992,348.84	72,658.84	-7,651.16	0.53

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 640068 R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P. R. U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	Devise du portefeuille				PRCT ACT NET	
									<-----> PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL		
Obligations à taux variable, révisable négo. sur u														
<i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>														
XS0203470157 AXA SA FLR PERP	(EUR)	311299	1,000,000.	M EUR	80.0083	% 30/06/23	80.982	4	800,083.33	815,487.64	5,667.64	15,404.31	0.22	
N00011093718 AXACTOR AB FLR 09-26	(999)	150926	2,100,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	91.8145	E	2,100,000.00	1,937,942.07	9,837.57	-162,057.93	0.52	
FR0000572646 BNP TMO 10/85 TSDI	(366)	311299	2,000,000.	M EUR	86.375	% 30/06/23	75.25	E	1,727,500.00	1,520,904.11	15,904.11	-206,595.89	0.41	
FR0010093328 CNP ASSURANCE TV04	(DEM)	311299	1,925,000.	M EUR	77.5893	% 30/06/23	81.434	E	1,493,593.53	1,569,759.43	2,154.93	76,165.90	0.42	
DE000DL19WG7 DEUT BK FLR PERP	(366)	311299	400,000.	M EUR	100.014	% 30/06/23	81.2925	4	400,056.00	329,965.08	4,795.08	-70,090.92	0.09	
DE000A2GSG24 IKB DEUT I FLR 01-28	(366)	310128	600,000.	M EUR	105.6295	% 30/06/23	79.795	E	633,776.71	495,320.99	16,550.99	-138,455.72	0.13	
XS2597970800 INTE FLR 03-25	(999)	170325	5,500,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	100.0435	4	5,500,000.00	5,511,964.79	9,572.29	11,964.79	1.47	
XS1640667116 RAIF BANK FLR PERP	(UST)	311299	2,000,000.	M EUR	81.7182	% 30/06/23	89.2165	4	1,634,363.39	1,793,714.75	9,384.75	159,351.36	0.48	
<i>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>														
									CUMUL (EUR)	14,289,372.96	13,975,058.86	73,867.36	-314,314.10	3.73
<i>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</i>														
NL0000116168 AEGON 0 07/29/49	(EUR)	311299	1,000,000.	M USD	73.5326	% 30/06/23	75.836	4	622,471.96	705,018.84	7,098.72	82,546.88	0.19	
Obligations convertibles négo. sur un marché regl.														
<i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>														
FR0013410628 AIR FRA 0.125 03-26	(366)	250326	100,000.	P EUR	16.3	M 30/06/23	17.2505	4	1,630,000.00	1,725,050.00	593.66	95,050.00	0.46	
FR0013457942 ATOS SE ZCP 11-24	(999)	061124	2,500,000.	M EUR	77.4485	% 30/06/23	87.806	4	1,936,211.50	2,195,150.00	0.00	258,938.50	0.59	
BE0933899800 BNP PARI F FLR PERP	(UST)	311299	1,250,000.	M EUR	88.5494	% 30/06/23	85.5	4	1,106,866.91	1,071,576.26	2,826.26	-35,290.65	0.29	
<i>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>														
									CUMUL (EUR)	4,673,078.41	4,991,776.26	3,419.92	318,697.85	1.33
Obligations & valeurs assimilées négociés sur un marché réglementé														
									CUMUL (EUR)	366,696,189.93	346,340,723.05	4,856,205.46	-20,355,466.88	92.45
III - Titres d'OPCVM														
<i>OPCVM français à vocation générale</i>														
<i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>														
FR00140060X7 R-CO CONV SUBFIN I			5,720.	P EUR	910.5615	M 29/06/23	885.43	5	5,208,412.00	5,064,659.60	0.00	-143,752.40	1.35	
<i>OPCVM européens coordonnés et assimilables</i>														
<i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>														
FR0007442496 RMM COURT TERME C			1,739.	P EUR	3969.4451	M 29/06/23	3970.52	5	6,902,865.03	6,904,734.28	0.00	1,869.25	1.84	
III - Titres d'OPCVM														
									CUMUL (EUR)	12,111,277.03	11,969,393.88	0.00	-141,883.15	3.20

VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHES A TERME

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 640068 R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<-----> PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	>-----> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
Engagements à terme fermes												
Futures étrangers												
SOUS-JACENT : CBTFV CBOT US TREASURY NOTES 5 ANS												
CFV___U3	FV CBOT UST 5 0923	2,160.	USD	108.0565	M 30/06/23	107.09375	4	0.00	-1,913,821.55	0.00	-1,913,821.55	-0.51
SOUS-JACENT : VIX CBOE SPX VOLATILITY INDEX												
IUX___N3	CBOE VIX FUT 0723	185.	USD	16.5702	M 30/06/23	15.011	4	0.00	-265,462.91	0.00	-265,462.91	-0.07
Futures étrangers												
								CUMUL (EUR)	0.00	-2,179,284.46	0.00	-2,179,284.46 -0.58
VII - AUTRES ENGAGEMENTS												
Swaps												
Swaps de taux												
DATE ECHEANCE : 21/07/24												
SWP026392101	NIB06R/0.0/FIX/3.31	190,000,000.	NOK	0.	30/06/23	104.94247	H	0.00	863,636.53	61,287.50	802,349.03	0.23
	NOL RECU	-190,000,000.	NOK	0.	30/06/23	103.33099	H	0.00	-1,046,738.10	-505,992.97	-540,745.13	-0.28
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 21/07/24												
								CUMUL (EUR)	0.00	-183,101.57	-444,705.47	261,603.90 -0.05
DATE ECHEANCE : 17/02/25												
SWP027711803	FIX/4.6375/CBA3M/0.0	97,000,000.	CAD	0.	30/06/23	107.18586	H	0.00	5,972,563.24	1,137,125.02	4,835,438.22	1.59
	NOL RECU	-97,000,000.	CAD	0.	30/06/23	107.977	H	0.00	-6,613,951.03	-1,246,146.66	-5,367,804.37	-1.77
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 17/02/25												
								CUMUL (EUR)	0.00	-641,387.79	-109,021.64	-532,366.15 -0.17
DATE ECHEANCE : 07/07/27												
SWP026338702	CHF01S/0.0/FIX/0.985	50,000,000.	CHF	0.	30/06/23	107.13622	H	0.00	4,007,901.34	362,509.02	3,645,392.32	1.07
	NOL RECU	-50,000,000.	CHF	0.	30/06/23	103.77673	H	0.00	-2,422,648.76	-493,383.34	-1,929,265.42	-0.65
SWP026339102	FIX/1.6605/E6R/0.0	50,000,000.	EUR	0.	30/06/23	106.13844	H	0.00	3,883,326.25	814,106.25	3,069,220.00	1.04
	NOL RECU	-50,000,000.	EUR	0.	30/06/23	112.55993	H	0.00	-6,942,165.00	-662,200.00	-6,279,965.00	-1.85
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 07/07/27												
								CUMUL (EUR)	0.00	-1,473,586.17	21,031.93	-1,494,618.10 -0.39
DATE ECHEANCE : 17/02/28												
SWP027712004	CBA3M/0.0/FIX/3.7683	94,000,000.	CAD	0.	30/06/23	117.30944	H	0.00	12,495,066.05	1,207,606.04	11,287,460.01	3.34
	NOL RECU	-94,000,000.	CAD	0.	30/06/23	115.56703	H	0.00	-11,046,642.55	-895,405.50	-10,151,237.05	-2.95
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 17/02/28												
								CUMUL (EUR)	0.00	1,448,423.50	312,200.54	1,136,222.96 0.39
DATE ECHEANCE : 22/07/29												
SWP026406102	SOFFRATE/0.0/FIX/2.7	4,250,000.	USD	0.	30/06/23	120.35237	H	0.00	942,445.69	146,406.92	796,038.77	0.25
	NOL RECU	-4,250,000.	USD	0.	30/06/23	114.86226	H	0.00	-685,254.35	-103,949.32	-581,305.03	-0.18
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 22/07/29												
								CUMUL (EUR)	0.00	257,191.34	42,457.60	214,733.74 0.07
DATE ECHEANCE : 12/01/32												

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 640068 R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P. R. U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	Devise du portefeuille				PRCT ACT NET
									<-----> PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL	
SWP026400804	FIX/2.05/NIB06R/0.0	NOL RECU	350,000,000.	NOK	0.	30/06/23	114.46048	H	0.00	4,610,390.75	286,084.53	4,324,306.22	1.23
		NOL VERSE	-350,000,000.	NOK	0.	30/06/23	127.77384	H	0.00	-8,426,325.68	-120,751.52	-8,305,574.16	-2.25
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 12/01/32													
CUMUL (EUR)									0.00	-3,815,934.93	165,333.01	-3,981,267.94	-1.02
DATE ECHEANCE : 17/02/33													
SWP027711904	FIX/3.6955/CBA3M/0.0	NOL RECU	30,000,000.	CAD	0.	30/06/23	129.25341	H	0.00	6,368,367.88	280,249.25	6,088,118.63	1.70
		NOL VERSE	-30,000,000.	CAD	0.	30/06/23	130.04151	H	0.00	-6,637,541.46	-385,406.18	-6,252,135.28	-1.77
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 17/02/33													
CUMUL (EUR)									0.00	-269,173.58	-105,156.93	-164,016.65	-0.07
DATE ECHEANCE : 22/07/42													
SWP026406001	FIX/2.8211/SOFFRATE/	NOL RECU	17,000,000.	USD	0.	30/06/23	138.86197	H	0.00	6,500,528.93	420,522.58	6,080,006.35	1.74
		NOL VERSE	-17,000,000.	USD	0.	30/06/23	147.58402	H	0.00	-8,030,210.25	-585,627.70	-7,444,582.55	-2.14
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 22/07/42													
CUMUL (EUR)									0.00	-1,529,681.32	-165,105.12	-1,364,576.20	-0.41
DATE ECHEANCE : 12/01/52													
SWP026400903	NIB06R/0.0/FIX/1.888	NOL RECU	131,000,000.	NOK	0.	30/06/23	155.5069	H	0.00	6,257,946.68	45,195.57	6,212,751.11	1.67
		NOL VERSE	-131,000,000.	NOK	0.	30/06/23	133.78697	H	0.00	-3,880,308.27	-98,615.63	-3,781,692.64	-1.04
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 12/01/52													
CUMUL (EUR)									0.00	2,377,638.41	-53,420.06	2,431,058.47	0.63
DATE ECHEANCE : 07/07/52													
SWP026342603	FIX/1.776/CHFOIS/0.0	NOL RECU	10,750,000.	CHF	0.	30/06/23	140.1353	H	0.00	4,599,256.66	191,262.43	4,407,994.23	1.23
		NOL VERSE	-10,750,000.	CHF	0.	30/06/23	138.52191	H	0.00	-4,308,737.68	-77,939.44	-4,230,798.24	-1.15
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 07/07/52													
CUMUL (EUR)									0.00	290,518.98	113,322.99	177,195.99	0.08
DATE ECHEANCE : 08/07/52													
SWP026338902	E6R/0.0/FIX/1.984	NOL RECU	10,750,000.	EUR	0.	30/06/23	150.97194	H	0.00	5,621,856.55	142,373.00	5,479,483.55	1.50
		NOL VERSE	-10,750,000.	EUR	0.	30/06/23	139.48754	H	0.00	-4,454,043.44	-209,132.89	-4,244,910.55	-1.19
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 08/07/52													
CUMUL (EUR)									0.00	1,167,813.11	-66,759.89	1,234,573.00	0.31
DATE ECHEANCE : 22/07/52													
SWP026406202	SOFFRATE/0.0/FIX/2.6	NOL RECU	11,500,000.	USD	0.	30/06/23	159.22642	H	0.00	6,664,371.12	396,159.91	6,268,211.21	1.78
		NOL VERSE	-11,500,000.	USD	0.	30/06/23	148.1584	H	0.00	-5,360,902.32	-264,071.84	-5,096,830.48	-1.43
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 22/07/52													
CUMUL (EUR)									0.00	1,303,468.80	132,088.07	1,171,380.73	0.35
Swaps de taux													
CUMUL (EUR)									0.00	-1,067,811.22	-157,734.97	-910,076.25	-0.29

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 640068 R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P. R. U EN DEVISE	DATE	COURS	I	<----->	Devise du portefeuille			>----->	PRCT	
	VAL/LIGNE		EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR. COURS	COTA	VALEUR	F	PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	ACT NET		
Swaps d'Inflation															
DATE ECHEANCE : 15/04/28															
PSW7586495	SWP INFLA	15042028	NOL RECU	40,000,000.	EUR	0.	30/06/23	111.47199	H	0.00	4,588,796.00	0.00	4,588,796.00	1.22	
			NOL VERSE	-40,000,000.	EUR	0.	30/06/23	111.164908	H	0.00	-4,648,613.20	-182,650.00	-4,465,963.20	-1.24	
PSW7586496	SWP INFLA	15042028	NOL RECU	40,000,000.	EUR	0.	30/06/23	113.213482	H	0.00	5,502,781.69	217,388.89	5,285,392.80	1.47	
			NOL VERSE	-40,000,000.	EUR	0.	30/06/23	112.897819	H	0.00	-5,159,127.60	0.00	-5,159,127.60	-1.38	
PSW7586498	SWP INFLA	15042028	NOL RECU	40,000,000.	EUR	0.	30/06/23	113.229824	H	0.00	5,509,571.27	217,641.67	5,291,929.60	1.47	
			NOL VERSE	-40,000,000.	EUR	0.	30/06/23	112.897819	H	0.00	-5,159,127.60	0.00	-5,159,127.60	-1.38	
PSW7586499	SWP INFLA	15042028	NOL RECU	40,000,000.	EUR	0.	30/06/23	111.47199	H	0.00	4,588,796.00	0.00	4,588,796.00	1.22	
			NOL VERSE	-40,000,000.	EUR	0.	30/06/23	111.016404	H	0.00	-4,589,464.38	-182,902.78	-4,406,561.60	-1.23	
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 15/04/28															
										CUMUL (EUR)	0.00	633,612.18	69,477.78	564,134.40	0.17
Swaps															
										CUMUL (EUR)	0.00	-434,199.04	-88,257.19	-345,941.85	-0.12
Dérivés de crédits															
Credit Default Swap (CDS)															
DATE ECHEANCE : 20/06/28															
CDS027149102	ITRAXX	EUR XOVER S39	APROT 20/06/28	-20,000,000.	EUR	0.	% 30/06/23	-3.96369	H	0.00	-820,515.78	-27,777.78	-820,515.78	-0.22	
CDS027295502	ITRAXX	EUR XOVER S39	APROT 20/06/28	-30,000,000.	EUR	0.	% 30/06/23	-3.96369	H	0.00	-1,234,940.33	-45,833.33	-1,234,940.33	-0.33	
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 20/06/28															
										CUMUL (EUR)	0.00	-2,055,456.11	-73,611.11	-2,055,456.11	-0.55
VII - AUTRES ENGAGEMENTS															
										CUMUL (EUR)	0.00	-2,489,655.15	-161,868.30	-2,401,397.96	-0.66
VIII - TRESORERIE															
Dettes et créances															
Règlements différés															
DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE															
VRDCHF	Vte rgl t	différé		-30,765.	CHF	1.02197237	30/06/23	1.02165917		-31,440.98	-31,431.34	0.00	9.64	-0.01	
DEVISE VALEUR : EUR EURO															
ARDEUR	Ach rgl t	différé		-5,255,222.02	EUR	1.	30/06/23	1.		-5,255,222.02	-5,255,222.02	0.00	0.00	-1.40	
RACHEUR	Rachats a	payer		-247,637.34	EUR	1.	30/06/23	1.		-247,637.34	-247,637.34	0.00	0.00	-0.07	
SOUSEUR	Souscriptions/payer			22,878.03	EUR	1.	30/06/23	1.		22,878.03	22,878.03	0.00	0.00	0.01	
VRDEUR	Vte rgl t	différé		-1,845,018.45	EUR	1.	30/06/23	1.		-1,845,018.45	-1,845,018.45	0.00	0.00	-0.49	
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO															
										CUMUL (EUR)	-7,324,999.78	-7,324,999.78	0.00	0.00	-1.96
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US															
ARDUSD	Ach rgl t	différé		2,000,000.	USD	0.92250923	30/06/23	0.92030186		1,845,018.45	1,840,603.72	0.00	-4,414.73	0.49	

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 640068 R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P. R. U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<-----> PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	>-----> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
Règlements différés												
						CUMUL (EUR)		-5,511,422.31	-5,515,827.40	0.00	-4,405.09	-1.47
Coupons et dividendes en espèces												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
XS2247623643	GETLINK 3.5 10-25	600.	P EUR	17.5	30/06/23			10,500.00	10,500.00	0.00	0.00	0.00
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US												
N00011100935	WALD PR 9.75 10-24	499,925.	P USD	0.02404109	30/06/23			10,988.06	11,060.87	0.00	72.81	0.00
Coupons et dividendes en espèces												
						CUMUL (EUR)		21,488.06	21,560.87	0.00	72.81	0.01
Deposit												
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US												
DGMRCUSD	Depôt gar. ROTHS MM	3,982,900.	USD	0.91817758	30/06/23	0.92030186		3,657,009.50	3,665,470.27	0.00	8,460.77	0.98
Appels de marge												
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US												
MARRCUSD	Appel Marge R.M.M.	2,368,010.51	USD	0.91429688	30/06/23	0.92030186		2,165,064.61	2,179,284.47	0.00	14,219.86	0.58
Frais de gestion												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
FGPVFC1EUR	Frais de Gest. Fixe	-109,812.23	EUR	1.	30/06/23	1.		-109,812.23	-109,812.23	0.00	0.00	-0.03
FGPVFC2EUR	Frais de Gest. Fixe	-85,033.49	EUR	1.	30/06/23	1.		-85,033.49	-85,033.49	0.00	0.00	-0.02
FGPVFC4EUR	Frais de Gest. Fixe	-451.96	EUR	1.	30/06/23	1.		-451.96	-451.96	0.00	0.00	0.00
FGPVFC6EUR	Frais de Gest. Fixe	-52.21	EUR	1.	30/06/23	1.		-52.21	-52.21	0.00	0.00	0.00
FGPVVC4EUR	Frais de Gest. var.	-47.09	EUR	1.	30/06/23	1.		-47.09	-47.09	0.00	0.00	0.00
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO												
						CUMUL (EUR)		-195,396.98	-195,396.98	0.00	0.00	-0.05
Dettes et créances												
						CUMUL (EUR)		136,742.88	155,091.23	0.00	18,348.35	0.04
Disponibilités												
Avoirs en france												
DEVISE VALEUR : CAD DOLLAR CANADIEN												
BQRCCAD	ROTHSCHI LD MM	0.04	CAD	0.75	30/06/23	0.69372182		0.03	0.03	0.00	0.00	0.00
DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE												
BQRCCHF	ROTHSCHI LD MM	113,682.75	CHF	1.01667201	30/06/23	1.02165917		115,578.07	116,145.02	0.00	566.95	0.03
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
BQRCEUR	ROTHSCHI LD MM	-4,680.96	EUR	1.	30/06/23	1.		-4,680.96	-4,680.96	0.00	0.00	0.00
DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING												
BQRGGBP	ROTHSCHI LD MM	154,605.45	GBP	1.16826975	30/06/23	1.16512094		180,620.87	180,134.05	0.00	-486.82	0.05

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 640068 R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V	A	L	E	U	R	STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P. R. U EN DEVISE	DATE	COURS	I	<----->	Devise du portefeuille			>----->	PRCT
						VAL/LIGNE		EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR. COURS	COTA	VALEUR	F	PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	ACT NET	
DEVISE VALEUR : JPY YEN																			
BQRCJPY						ROTHSCHILD MM		2,930,532,600.	JPY	0.00680265	30/06/23	0.00636294		19,935,373.09	18,646,809.62	0.00	-1,288,563.47	4.98	
DEVISE VALEUR : NOK COURONNE NORVEGIENNE																			
BQRCNOK						ROTHSCHILD MM		485,731.84	NOK	0.09450818	30/06/23	0.08544087		45,905.63	41,501.35	0.00	-4,404.28	0.01	
DEVISE VALEUR : SEK COURONNE SUEDOISE																			
BQRCSEK						ROTHSCHILD MM		45,414.94	SEK	0.09389862	30/06/23	0.08470628		4,264.40	3,846.93	0.00	-417.47	0.00	
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US																			
BQRCUSD						ROTHSCHILD MM		-844,823.19	USD	0.91472436	30/06/23	0.92030186		-772,780.35	-777,492.35	0.00	-4,712.00	-0.21	
Avoirs en france																			
													CUMUL (EUR)	19,504,280.78	18,206,263.69	0.00	-1,298,017.09	4.86	
Opérations à terme																			
DATE ECHEANCE : 15/09/23																			
23164001773	A	CHF	EUR	15/09/23	RECU	15/09/23	599,900.	CHF	1.027	30/06/23	1.02563117		616,102.92	615,276.14	0.00	-826.78	0.16		
					VERSE	15/09/23	-616,102.92	EUR	1.	30/06/23	1.		-616,102.92	-616,102.92	0.00	0.00	-0.16		
23164001774	A	CHF	EUR	15/09/23	RECU	15/09/23	102,400.	CHF	1.027	30/06/23	1.02563118		105,165.76	105,024.63	0.00	-141.13	0.03		
					VERSE	15/09/23	-105,165.76	EUR	1.	30/06/23	1.		-105,165.76	-105,165.76	0.00	0.00	-0.03		
23164003518	V	USD	EUR	15/09/23	RECU	15/09/23	17,484,995.11	EUR	1.	30/06/23	1.		17,484,995.11	17,484,995.11	0.00	0.00	4.67		
					VERSE	15/09/23	-19,000,000.	USD	0.9203	30/06/23	0.91632959		-17,484,995.11	-17,410,262.12	0.00	74,732.99	-4.65		
23164003598	V	GBP	EUR	15/09/23	RECU	15/09/23	1,972,727.62	EUR	1.	30/06/23	1.		1,972,727.62	1,972,727.62	0.00	0.00	0.53		
					VERSE	15/09/23	-1,700,000.	GBP	1.1604	30/06/23	1.16153242		-1,972,727.62	-1,974,605.12	0.00	-1,877.50	-0.53		
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 15/09/23																			
													CUMUL (EUR)	0.00	71,887.58	0.00	71,887.58	0.02	
Collatéral Cash																			
DEVISE VALEUR : EUR EURO																			
C0027588						COLLAT CDS BNP PRET		-70,000.	EUR	1.	30/06/23	1.		-70,000.00	-70,000.00	0.00	0.00	-0.02	
Coll cash OTC																			
DEVISE VALEUR : EUR EURO																			
640068MS						COLLAT MS		-540,000.	EUR	1.	30/06/23	1.		-540,000.00	-540,000.00	0.00	0.00	-0.14	
640068SG						COLLAT SG		1,000,000.	EUR	1.	30/06/23	1.		1,000,000.00	1,000,000.00	0.00	0.00	0.27	
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO																			
													CUMUL (EUR)	460,000.00	460,000.00	0.00	0.00	0.12	
Autres disponibilités																			
DEVISE VALEUR : EUR EURO																			
CLLAT CDS						COLLAT CDS JPM		2,160,000.	EUR	1.	30/06/23	1.		2,160,000.00	2,160,000.00	0.00	0.00	0.58	

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

PORTEFEUILLE : 640068 R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES

VL VALIDEE

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<-----> PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	>-----> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
Disponibilités													
						CUMUL (EUR)			22,054,280.78	20,828,151.27	0.00	-1,226,129.51	5.56
VIII - TRESORERIE													
						CUMUL (EUR)			22,191,023.66	20,983,242.50	0.00	-1,207,781.16	5.60
PORTEFEUILLE : R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES (640068)													
						(EUR)			400,998,490.62	374,624,419.82	4,694,337.16	-26,285,813.61	100.00

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 640068 R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

Portefeuille titres : 353,713,064.9 Coupons et dividendes a recevoir : 21,560.87

Frais de gestion du jour

Frais de Gest. var. :	24.34	EUR
Frais de Gest. Fixe :	3,689.14	EUR
Frais de Gest. Fixe :	2,765.31	EUR
Frais de Gest. Fixe :	14.94	EUR
Frais de Gest. Fixe :	1.72	EUR

Frais de gestion charge Entreprise

FRAIS MAXIMUM :	3,689.14	EUR
FRAIS MAXIMUM :	2,765.31	EUR
Frais maximum notice :	14.94	EUR
Frais maximum notice :	1.72	EUR

Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
C1	FR0013417524 R-CO VALOR BOND OPPC EUR	149,611,276.01	1,420,190.7132	105.35	39.936527527873			107.46	105.35
C2	FR0013417532 R-CO VALOR BOND OPPI EUR	224,294,929.75	209,620.0832	1,070.01	59.871491225093			1,091.41	1,048.61
C4	FR0014009K58 R-CO VAL BD OPP C CH EUR	605,846.90	5,800.	104.46	0.161949098362			106.55	102.37
C6	FR0014009K66 R-CO VAL BD OPP P CH EUR	104,899.47	1,000.	104.90	0.028038809995			107.00	102.80
C7	FR0014001863 R-CO VL BD OP M EUR EUR	7,467.69	7.5	995.69	0.001993338677			1,045.47	995.69
C3	FR0014007NT2 R-CO VL BD OP-PEUR EUR	0.00	0.	100.00	0.			0.00	0.00
C5	FR0014009K41 R-CO VAL BD OP IC CH EUR	0.00	0.	1.00	0.			0.00	0.00
D1	FR0014007NS4 R-CO VL BD OP DEUR EUR	0.00	0.	100.00	0.			0.00	0.00
D2	FR0014007NU0 R-CO VL BD OP PB EUR EUR	0.00	0.	100.00	0.			0.00	0.00

Actif net total en EUR : 374,624,419.82

C4	CHF	593,002.95		102.24		0.9788		104.28	100.2
C6	CHF	102,675.6		102.68		0.9788		104.73	100.63
C5	CHF	0.		1,000.		0.		0.	0.

Precedente VL en date du 29/06/23 :

C1	R-CO VALOR BOND OPPC	Prec. VL :	105.3	(EUR)	Variation :	+0.047%
C2	R-CO VALOR BOND OPPI	Prec. VL :	1,069.54	(EUR)	Variation :	+0.044%
C4	R-CO VAL BD OPP C CH	Prec. VL :	104.48	(EUR)	Variation :	-0.019%
C6	R-CO VAL BD OPP P CH	Prec. VL :	104.91	(EUR)	Variation :	-0.010%

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

PORTEFEUILLE : 640068 R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES

VL VALIDEE

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

C7 R-CO VL BD OP M EUR Prec. VL : 995.24 (EUR) Variation : +0.045%

VL theorique

Part	Devise	Actif theorique	Valeur liquidative theorique
C1 FR0013417524 R-CO VALOR BOND OPPC	EUR	149,611,276.01	105.35
C2 FR0013417532 R-CO VALOR BOND OPPI	EUR	224,294,929.75	1,070.01
C4 FR0014009K58 R-CO VAL BD OPP C CH	EUR	605,846.90	104.46
C6 FR0014009K66 R-CO VAL BD OPP P CH	EUR	104,899.47	104.90
C7 FR0014001863 R-CO VL BD OP M EUR	EUR	7,467.69	995.69

Actif theorique total en EUR : 374,624,419.82 (Sens collecte : EQU)

C4	CHF	593,002.95	102.24
C6	CHF	102,675.6	102.68

Fiscalite de l'epargne : poids et statuts des parts du portefeuille

Type reporting : TIBR Revenu taxable pour residents Belges

Poids officiels et statuts en date du 01/05/23 :

Poids DD : 93.72 Statut DD : 0

Poids DI : 99.05 Statut DI : M

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

PORTEFEUILLE : 640068 R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES

VL VALIDEE

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : NPC - TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

COURS DES DEVISES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente		variation	
Cours CHF en EUR :	1.0216591745	cotation :	30/06/23	0.	1.022181335	cotation :	29/06/23	-0.05108
Cours EUR en CAD :	1.4415	cotation :	30/06/23	0.	1.4503	cotation :	29/06/23	-0.60677
Cours EUR en CHF :	0.9788	cotation :	30/06/23	0.	0.9783	cotation :	29/06/23	0.05111
Cours EUR en EUR :	1.	cotation :	30/06/23	0.	1.	cotation :	29/06/23	0.
Cours EUR en GBP :	0.85828	cotation :	30/06/23	0.	0.864	cotation :	29/06/23	-0.66204
Cours EUR en JPY :	157.16	cotation :	30/06/23	0.	157.74	cotation :	29/06/23	-0.36769
Cours EUR en NOK :	11.704	cotation :	30/06/23	0.	11.7645	cotation :	29/06/23	-0.51426
Cours EUR en SEK :	11.8055	cotation :	30/06/23	0.	11.8175	cotation :	29/06/23	-0.10154
Cours EUR en USD :	1.0866	cotation :	30/06/23	0.	1.0938	cotation :	29/06/23	-0.65826
Cours GBP en EUR :	1.1651209396	cotation :	30/06/23	0.	1.1574074074	cotation :	29/06/23	0.66645
Cours USD en EUR :	0.920301859	cotation :	30/06/23	0.	0.9142439203	cotation :	29/06/23	0.66262

COURS INVERSES DES DEVISES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente		
Cours EUR en CHF :	0.9787999999	cotation :	30/06/23	0.	0.9782999999	cotation :	29/06/23
Cours CAD en EUR :	0.6937218175	cotation :	30/06/23	0.	0.6895125146	cotation :	29/06/23
Cours CHF en EUR :	1.0216591744	cotation :	30/06/23	0.	1.0221813349	cotation :	29/06/23
Cours EUR en EUR :	1.	cotation :	30/06/23	0.	1.	cotation :	29/06/23
Cours GBP en EUR :	1.1651209395	cotation :	30/06/23	0.	1.1574074074	cotation :	29/06/23
Cours JPY en EUR :	0.0063629422	cotation :	30/06/23	0.	0.006339546	cotation :	29/06/23
Cours NOK en EUR :	0.0854408749	cotation :	30/06/23	0.	0.0850014875	cotation :	29/06/23
Cours SEK en EUR :	0.0847062809	cotation :	30/06/23	0.	0.0846202665	cotation :	29/06/23
Cours USD en EUR :	0.920301859	cotation :	30/06/23	0.	0.9142439202	cotation :	29/06/23
Cours EUR en GBP :	0.8582799999	cotation :	30/06/23	0.	0.864	cotation :	29/06/23
Cours EUR en USD :	1.0866	cotation :	30/06/23	0.	1.0937999999	cotation :	29/06/23

R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES

DOCUMENT D'INFORMATION PÉRIODIQUE AU 30/06/2023

ETAT DU PATRIMOINE EN EUR

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier	346 340 723,05
b) Avoirs bancaires	18 988 437,00
c) Autres actifs détenus par l'OPC	52 161 619,22
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	417 490 779,27
e) Passif	-42 866 359,45
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	374 624 419,82

* Les montants sont signés

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

Action	Type d'action	Actif net par action	Nombre d'actions en circulation	Valeur nette d'inventaire par action
R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES C CHF H en CHF	C	593 002,95	5 800,0000	102,24
R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES C EUR en EUR	C	149 611 276,01	1 420 190,7132	105,35
R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES I EUR en EUR	C	224 294 929,75	209 620,0832	1 070,01
R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES M EUR en EUR	C	7 467,69	7,5000	995,69
R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES P CHF H en CHF	C	102 675,60	1 000,0000	102,68

ELÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	79,27	71,13
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	13,18	11,82
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	3,20	2,87

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

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

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

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Euro	EUR	327 993 033,11	87,55	78,56
Dollar Us	USD	16 743 256,22	4,47	4,01
Livre Sterling	GBP	1 604 433,72	0,43	0,38
TOTAL		346 340 723,05	92,45	82,96

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

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

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

Pays	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
FRANCE	19,78	17,74
ITALIE	10,75	9,64
PAYS-BAS	9,09	8,16
ALLEMAGNE	6,89	6,18
ESPAGNE	5,75	5,16
ETATS-UNIS	4,76	4,27
LUXEMBOURG	4,31	3,87
ROYAUME-UNI	4,01	3,60
PORTUGAL	3,99	3,58
AUTRICHE	3,63	3,25
BELGIQUE	3,49	3,13
IRLANDE	3,05	2,73
SUEDE	2,49	2,23
REPUBLIQUE TCHEQUE	1,54	1,38
CANADA	1,21	1,08
SLOVENIE	1,14	1,02
POLOGNE	0,89	0,80
FINLANDE	0,78	0,70
DANEMARK	0,72	0,65
JAPON	0,65	0,59
MEXIQUE	0,60	0,54
MAURICE	0,57	0,51
NORVEGE	0,52	0,46
BERMUDES	0,50	0,45
HONGRIE	0,49	0,44
AUSTRALIE	0,44	0,40
SUISSE	0,24	0,21
JERSEY	0,20	0,18
TOTAL	92,45	82,96

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

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

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

Nature d'actifs	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Organismes de placement collectif		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	3,20	2,87
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE	0,00	0,00
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés	0,00	0,00
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés	0,00	0,00
Autres organismes non européens	0,00	0,00
Autres actifs		
Autres	0,00	0,00
TOTAL	3,20	2,87

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

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

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	89 922 042,52	23 801 350,26
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	29 019 625,79	9 793 164,69
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	90 736 322,00	99 720 253,47

INFORMATION SUR LES FRAIS DE GESTION VARIABLES

	30/06/2023
Action R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES C CHF H	
Frais de gestion variables provisionnés	47,09
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,02
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Action R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES C EUR	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Action R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES I EUR	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Action R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES M EUR	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Action R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES P CHF H	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00

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

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2023 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Dépôts				
COLLAT CDS JPM	EUR	2 160 000	2 160 000,00	0,58
TOTAL Dépôts			2 160 000,00	0,58
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
ACCENTRO REAL ESTATE AG 3.625% 13-02-26	EUR	3 500 000	1 979 458,52	0,53
ALLIANZ SE 3.2% PERP	USD	5 000 000	3 437 759,47	0,92
BAYER 2.375% 12-11-79	EUR	600 000	560 753,52	0,15
CECONOMY AG 1.75% 24-06-26	EUR	5 000 000	3 929 965,71	1,05
CMZB FRANCFORT 6.5% 06-12-32	EUR	1 500 000	1 548 550,89	0,41
CT INVESTMENT 5.5% 15-04-26	EUR	1 000 000	944 889,44	0,25
DEUTSCHE BK AUTRE V PERP	EUR	400 000	329 965,08	0,09
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2.0% 14-07-24	EUR	2 000 000	1 992 304,11	0,54
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 5.75% PERP	EUR	1 600 000	1 119 249,53	0,30
HAMBURG COMMERCIAL BANK AG 4.875% 17-03-25	EUR	4 200 000	4 245 752,46	1,13
IKB DEUTSCHE INDUSTRIEBANK AG EUSA5+3.617% 31-01-28	EUR	600 000	495 320,99	0,13
VONOVIA SE 4.75% 23-05-27 EMTN	EUR	3 000 000	2 962 547,46	0,79
WUESTENROT WUERTEMBERGISCHE AG 2.125% 10-09-41	EUR	3 100 000	2 249 301,40	0,60
TOTAL ALLEMAGNE			25 795 818,58	6,89
AUSTRALIE				
COBURN RESOURCES PTY 12.0% 20-03-26	USD	1 800 000	1 654 309,77	0,44
TOTAL AUSTRALIE			1 654 309,77	0,44
AUTRICHE				
IMMOFINANZ AG 2.5% 15-10-27	EUR	600 000	497 979,12	0,14
OMV AG 0.0% 03-07-25 EMTN	EUR	4 000 000	3 701 600,00	0,99
POSAV 5.375% PERP	EUR	1 800 000	1 653 758,14	0,44
RAIFFEISEN BANK INTL AG 1.5% 12-03-30	EUR	1 800 000	1 559 712,84	0,42
RAIFFEISEN BANK INTL AG 7.375% 20-12-32	EUR	1 000 000	1 034 467,74	0,27
RAIFFEISEN BANK INTL AG EUSA5+5.954% PERP	EUR	2 000 000	1 793 714,75	0,48
VILKSBANK WIEN AG 7.75% PERP	EUR	1 800 000	1 574 820,69	0,42
VOLKSBANK WIEN AG SVP 0.875% 23-03-26	EUR	2 000 000	1 768 284,86	0,47
TOTAL AUTRICHE			13 584 338,14	3,63
BELGIQUE				
AGEAS NV 3.875% PERP	EUR	2 000 000	1 454 061,97	0,38
AGEAS NV EX FORTIS 1.875% 24-11-51	EUR	1 300 000	962 518,84	0,25
ALIAxis FINANCE 0.875% 08-11-28	EUR	2 000 000	1 609 150,96	0,43
BNP PARIBAS FORTIS SA E3R+2.0% PERP	EUR	1 250 000	1 071 576,26	0,29
CRELAN 5.375% 31-10-25 EMTN	EUR	3 200 000	3 301 363,29	0,88
GBLBBB 1 7/8 06/19/25	EUR	2 000 000	1 917 599,34	0,52
VGP 1.5% 08-04-29	EUR	1 600 000	1 118 152,92	0,30
VGP 1.625% 17-01-27	EUR	2 000 000	1 635 898,90	0,44
TOTAL BELGIQUE			13 070 322,48	3,49
BERMUDES				
ODFJELL DRILLING 9.25% 31-05-28	USD	2 000 000	1 870 589,80	0,50
TOTAL BERMUDES			1 870 589,80	0,50
CANADA				

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
DAIMLER CANADA FINANCE 3.0% 23-02-27	EUR	2 500 000	2 461 855,31	0,65
INTL PETROLEUM 7.25% 01-02-27	USD	2 300 000	2 055 707,02	0,55
TOTAL CANADA			4 517 562,33	1,20
DANEMARK				
TDC NET AS 5.056% 31-05-28	EUR	2 750 000	2 715 960,03	0,73
TOTAL DANEMARK			2 715 960,03	0,73
ESPAGNE				
ABANCA CORPORACION BANCARIA 5.5% 18-05-26	EUR	3 500 000	3 505 224,95	0,94
ABANCA CORPORACION BANCARIA 6.0% PERP	EUR	1 000 000	876 922,64	0,24
BANCO DE BADELL 9.375% PERP	EUR	3 000 000	2 978 315,19	0,79
BANCO NTANDER 5.75% 23-08-33	EUR	5 000 000	5 003 032,19	1,33
BBVA 5.875% PERP	EUR	1 600 000	1 590 450,35	0,43
CAIXABANK 3.625% PERP	EUR	1 000 000	684 350,11	0,18
CELLNEX FINANCE 1.25% 15-01-29	EUR	1 100 000	919 728,61	0,24
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCOMI 1.75% 22-07-26	EUR	1 000 000	861 616,99	0,23
MAPFRE 2.875% 13-04-30	EUR	2 000 000	1 735 632,51	0,47
SCYRSM 3 1/4 04/02/24	EUR	1 500 000	1 494 224,39	0,40
UNICAJA BAN 3.125% 19-07-32	EUR	2 200 000	1 876 942,66	0,50
TOTAL ESPAGNE			21 526 440,59	5,75
ETATS-UNIS				
BERKSHIRE HATHAWAY 0.0% 12-03-25	EUR	5 000 000	4 682 075,00	1,25
CARNIVAL CORPORATION 7.625% 01-03-26	EUR	3 000 000	2 997 111,25	0,80
CELANESE US HOLDINGS LLC 4.777% 19-07-26	EUR	2 150 000	2 198 970,23	0,59
CORNING 3.875% 15-05-26	EUR	3 650 000	3 629 007,81	0,97
HARLEY DAVIDSON FINANCIAL SERVICE 5.125% 05-04-26	EUR	2 500 000	2 555 306,15	0,68
PM 2 3/4 03/19/25	EUR	1 800 000	1 778 885,31	0,47
TOTAL ETATS-UNIS			17 841 355,75	4,76
FINLANDE				
CITYCON OYJ 3.625% PERP	EUR	1 500 000	840 549,86	0,23
CITYCON OYJ 4.496% PERP	EUR	300 000	200 258,85	0,05
FINNAIR 4.25% 19-05-25	EUR	2 000 000	1 883 435,00	0,50
TOTAL FINLANDE			2 924 243,71	0,78
FRANCE				
AIR FRANCE KLM 0.125% 25-03-26	EUR	100 000	1 725 050,00	0,46
AIR FR KLM 1.875% 16-01-25	EUR	3 000 000	2 847 139,52	0,76
AIR FR KLM 8.125% 31-05-28	EUR	2 100 000	2 194 810,41	0,58
ALAIN AFFLELOU 4.25% 19-05-26	EUR	1 000 000	965 802,50	0,26
ALTAREA COGEDIM 1.875% 17-01-28	EUR	600 000	490 689,08	0,13
APICIL PREVOYANCE 4.0% 24-10-29	EUR	600 000	554 967,62	0,15
ATOS SE ZCP 06-11-24 CV	EUR	2 500 000	2 195 150,00	0,59
AXA SA EUAR10+0.05% PERP EMTN	EUR	1 000 000	815 487,64	0,22
BNP PAR 6.875% PERP	EUR	3 200 000	3 094 366,60	0,83
BNP PARIBAS TMO OCT85 TSDI	EUR	2 000 000	1 520 904,11	0,40
BPCE 1.5% 13-01-42	EUR	2 000 000	1 701 156,99	0,45
BPCE 3.625% 17-04-26 EMTN	EUR	2 800 000	2 777 881,15	0,74
BQ POSTALE 3.0% PERP	EUR	3 000 000	2 002 570,43	0,54
CA 7.25% PERP EMTN	EUR	1 900 000	1 899 111,03	0,51

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CARRE 0.75% 26-04-24 EMTN	EUR	4 000 000	3 905 715,74	1,05
CCR RE 2.875% 15-07-40	EUR	300 000	247 427,57	0,06
CLARIANE 4.125% PERP	GBP	1 700 000	1 604 433,72	0,42
CNP ASSURANCES 4.875% PERP	USD	3 200 000	2 233 304,07	0,60
CNP ASSURANCE TV04-PERP	EUR	1 925 000	1 569 759,43	0,42
CREDIT MUTUEL ARKEA 3.875% 22-05-28	EUR	2 500 000	2 494 268,99	0,66
EDF 2.625% PERP	EUR	4 000 000	3 247 147,21	0,86
EDF 4.0% PERP	EUR	1 000 000	1 002 917,81	0,26
EDF 4.5% 04-12-69 EMTN	USD	1 000 000	642 757,22	0,17
ERAMET 5.875% 21-05-25	EUR	1 300 000	1 335 714,69	0,36
ERAMET SA 5.1% 28-05-26	EUR	2 000 000	1 948 931,48	0,52
GETLINK 3.5% 30-10-25	EUR	600 000	587 828,33	0,15
HOLDING D INFRASTRUCTURES DES METIERS 4.5% 06-04-27	EUR	1 600 000	1 595 740,20	0,43
ILIAD 1.875% 25-04-25	EUR	1 500 000	1 428 106,60	0,38
ILIAD HOLDING HOLD 5.125% 15-10-26	EUR	1 500 000	1 454 139,79	0,39
IM GROUP SAS 8.0% 01-03-28	EUR	2 300 000	2 113 793,28	0,56
LA FINANCIERE ATALIAN 4.0% 15-05-24	EUR	2 600 000	1 954 756,56	0,52
MERCIALYS 2.5% 28-02-29	EUR	2 000 000	1 655 693,11	0,45
MIDCO GB SASU 7.75% 01-11-27	EUR	1 700 000	1 623 997,25	0,44
MUTUELLE ASSUR DES COMMERC ET IND FR 0.625% 21-06-27	EUR	1 500 000	1 283 192,99	0,34
MUTUELLE ASSUR DES COMMERC ET IND FR 3.5% PERP	EUR	2 000 000	1 442 006,34	0,39
ORPEA 2.625% 10-03-25 EMTN	EUR	3 000 000	934 859,02	0,25
SG 7.875% PERP EMTN	EUR	2 000 000	1 992 348,84	0,54
TECHNIP ENERGIES NV 1.125% 28-05-28	EUR	2 900 000	2 484 683,16	0,66
TIKEHAU CAPITAL 2.25% 14-10-26	EUR	500 000	468 776,16	0,12
TOTALENERGIES SE 1.75% PERP	EUR	1 000 000	973 601,09	0,26
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	EUR	1 600 000	1 236 608,26	0,33
UNIBAIL RODAMCO SE 2.125% PERP	EUR	6 700 000	5 835 205,76	1,56
TOTAL FRANCE			74 082 801,75	19,77
HONGRIE				
RAIFFEISEN BANK RT BUDAPEST 8.75% 22-11-25	EUR	1 700 000	1 846 129,67	0,49
TOTAL HONGRIE			1 846 129,67	0,49
IRLANDE				
AIB GROUP 2.875% 30-05-31 EMTN	EUR	1 400 000	1 275 182,04	0,34
BK IRELAND 1.375% 11-08-31	EUR	850 000	749 715,72	0,20
BK IRELAND 2.375% 14-10-29	EUR	500 000	486 004,01	0,13
GE CAP EU 3.65% 23-08-32 EMTN	EUR	1 500 000	1 510 387,50	0,41
GRENKE FINANCE 0.625% 09-01-25	EUR	2 000 000	1 821 227,40	0,48
GRENKE FINANCE 3.95% 09-07-25	EUR	1 950 000	1 941 339,86	0,52
GRENKE FINANCE 4.125% 14-10-24	EUR	950 000	960 024,97	0,26
SECURITAS TREASURY IRELAND DAC 4.25% 04-04-27	EUR	2 650 000	2 668 064,89	0,71
TOTAL IRLANDE			11 411 946,39	3,05
ITALIE				
ANIMA 1.5% 22-04-28	EUR	1 100 000	941 497,48	0,25
AUTOSTRADA PER L ITALILIA 2.0% 04-12-28	EUR	4 500 000	3 994 791,47	1,06
BANCA IFIS 4.5% 17-10-27 EMTN	EUR	900 000	904 742,82	0,24
BANCA IFIS 6.125% 19-01-27	EUR	2 000 000	2 058 812,33	0,55

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BANCO BPM 3.375% 19-01-32	EUR	4 000 000	3 560 837,26	0,95
BANCO BPM 6.5% PERP	EUR	500 000	471 153,31	0,12
BFF BANK 5.875% PERP	EUR	1 800 000	1 577 062,09	0,42
CASSA CENTRALE RAIFFEISEN DELLALTO ADIG 5.885% 16-02-27	EUR	2 850 000	2 919 184,14	0,78
ENEL 6.375% PERP EMTN	EUR	1 100 000	1 142 214,84	0,31
ENI 2.0% PERP	EUR	2 150 000	1 835 327,76	0,49
ENI 2.625% PERP	EUR	900 000	842 498,88	0,23
GAMENET GROUP 5.125% 15-07-23	EUR	1 000 000	1 037 174,03	0,28
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE 1.625% 20-10-28	EUR	850 000	758 852,17	0,20
INTE 6.375% PERP	EUR	1 400 000	1 241 093,61	0,33
INTE E3R+0.63% 17-03-25 EMTN	EUR	5 500 000	5 511 964,79	1,47
LOTTOMATICA 9.75% 30-09-27	EUR	3 100 000	3 498 910,58	0,93
REKEEP 7.25% 01-02-26	EUR	1 000 000	972 982,50	0,26
SRGIM 1 09/18/23	EUR	2 500 000	2 504 557,02	0,67
UBI BANCA UNIONE DI BANCHE ITALIANE 5.875% PERP	EUR	600 000	568 540,36	0,15
UNICREDIT 2.731% 15-01-32	EUR	2 000 000	1 776 319,45	0,48
UNICREDIT 5.375% PERP	EUR	1 000 000	921 777,60	0,25
UNICREDIT 5.85% 15-11-27 EMTN	EUR	1 150 000	1 221 390,03	0,33
TOTAL ITALIE			40 261 684,52	10,75
JAPON				
SOFTBANK GROUP 2.125% 06-07-24	EUR	2 500 000	2 447 506,49	0,65
TOTAL JAPON			2 447 506,49	0,65
JERSEY				
ATRIUM EUROPEAN REAL ESTATE 3.625% PERP	EUR	2 000 000	737 228,49	0,20
TOTAL JERSEY			737 228,49	0,20
LUXEMBOURG				
ACEF HOLDING SCA 0.75% 14-06-28	EUR	1 150 000	941 941,81	0,25
BANQUE INTLE A LUXEMBOURG 1.75% 18-08-31	EUR	1 100 000	991 119,21	0,26
BK LC LUX FINCO1 SARL 5.25% 30-04-29	EUR	600 000	571 748,00	0,15
BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS 1.25% 26-04-27	EUR	3 000 000	2 406 919,67	0,64
EDREAMS ODIGEO 5.5% 15-07-27	EUR	1 500 000	1 408 956,67	0,38
QUINTET PRIVATE BANK 7.5% PERP	EUR	2 000 000	1 789 597,07	0,48
TRAFIGURA FUNDING 3.875% 02-02-26	EUR	4 000 000	3 837 487,95	1,02
TRATON FINANCE LUXEMBOURG 4.0% 16-09-25	EUR	2 800 000	2 783 479,62	0,75
TUI CRUISES 6.5% 15-05-26	EUR	1 500 000	1 408 015,83	0,37
TOTAL LUXEMBOURG			16 139 265,83	4,30
MAURICE				
BAYPORT MANAGEMENT 13.0% 20-05-25	USD	2 500 000	2 121 925,93	0,57
TOTAL MAURICE			2 121 925,93	0,57
MEXIQUE				
NEMAK SAB CV 2.25% 20-07-28	EUR	2 700 000	2 253 821,49	0,60
TOTAL MEXIQUE			2 253 821,49	0,60
NORVEGE				
AXACTOR AB E3R+5.35% 15-09-26	EUR	2 100 000	1 937 942,07	0,52
TOTAL NORVEGE			1 937 942,07	0,52
PAYS-BAS				
ABN AMRO BK 3.75% 20-04-25	EUR	3 400 000	3 397 499,05	0,91

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
AEGON 0 07/29/49	USD	1 000 000	705 018,84	0,19
ATRIUM FINANCE ISSUER BV 2.625% 05-09-27	EUR	1 650 000	1 239 173,39	0,33
CETIN FINANCE BV 3.125% 14-04-27	EUR	2 800 000	2 610 960,75	0,69
CITYCON TREASURY BV 1.625% 12-03-28	EUR	850 000	625 626,75	0,17
COOPERATIEVE RABOBANK UA 4.375% PERP	EUR	1 200 000	1 051 167,21	0,28
COOPERATIEVE RABOBANK UA 4.875% PERP	EUR	1 000 000	842 490,98	0,22
EASYJET FINCO BV 1.875% 03-03-28	EUR	2 600 000	2 290 980,20	0,62
FERROVIAL NETHERLANDS BV 2.124% PERP	EUR	3 800 000	3 798 440,75	1,02
NE PROPERTY BV 3.375% 14-07-27	EUR	1 400 000	1 304 625,48	0,35
NIBC BANK NV 6.0% PERP	EUR	500 000	395 297,38	0,11
PPF ARENA 2.125% 31-01-25 EMTN	EUR	850 000	825 626,89	0,22
PPF ARENA 3.5% 20-05-24 EMTN	EUR	350 000	351 513,15	0,09
SCHLUMBERGER FINANCE BV 1.375% 28-10-26	EUR	4 000 000	3 747 880,55	1,00
VITERRA FINANCE BV 1.0% 24-09-28	EUR	1 200 000	1 023 256,11	0,27
WINTERSHALL DEA FINANCE 2 BV 2.4985% PERP	EUR	3 000 000	2 630 354,30	0,70
WINTERSHALL DEA SCHWEIZ BV 0.84% 25-09-25	EUR	2 500 000	2 320 062,16	0,62
WIZZ AIR FINANCE CO BV 1.0% 19-01-26	EUR	5 500 000	4 887 948,70	1,30
TOTAL PAYS-BAS			34 047 922,64	9,09
POLOGNE				
MBANK 0.966% 21-09-27 EMTN	EUR	1 300 000	1 026 868,97	0,27
PKO BANK POLSKI 5.625% 01-02-26	EUR	2 250 000	2 308 260,98	0,62
TOTAL POLOGNE			3 335 129,95	0,89
PORTUGAL				
BCP 8.5% 25-10-25 EMTN	EUR	2 000 000	2 187 489,86	0,58
CAIXA CENTRAL DE CREDITO AGRICOLA MUTUO 8.375% 04-07-27	EUR	2 300 000	2 303 680,00	0,62
GALP GAS NATURAL DISTRIBUICAO 4.875% 03-07-28	EUR	3 000 000	3 001 119,59	0,80
NOVO BAN 3.5% 23-07-24	EUR	2 500 000	2 578 357,71	0,69
NOVO BAN 9.875% 01-12-33	EUR	4 700 000	4 893 912,99	1,30
TOTAL PORTUGAL			14 964 560,15	3,99
REPUBLIQUE TCHEQUE				
CE ENERGY AS 1.659% 26-04-24	EUR	3 500 000	3 349 561,68	0,89
CESKA SPORITELNA AS 5.943% 29-06-27	EUR	2 400 000	2 404 168,52	0,64
TOTAL REPUBLIQUE TCHEQUE			5 753 730,20	1,53
ROYAUME-UNI				
BP CAP MK 3.25% PERP	EUR	950 000	879 439,30	0,24
BRITISH AMERICAN TOBAC 3.0% PERP	EUR	3 000 000	2 569 212,74	0,68
CRED SUIS SA AG LONDON BRANCH 5.5% 20-08-26	EUR	4 000 000	4 148 507,12	1,11
EG GLOBAL FINANCE 6.25% 30-10-25	EUR	1 000 000	964 821,11	0,26
INTL PERSONAL FINANCE 9.75% 12-11-25	EUR	2 000 000	1 905 993,70	0,51
JAGUAR LAND ROVER 5.875% 15-11-24	EUR	2 500 000	2 530 128,82	0,67
TECHNIPFMC 6.5% 01-02-26	USD	1 666 000	1 561 196,55	0,42
WALDORF PRODUCTION UK 9.75% 01-10-24	USD	499 925	460 687,55	0,12
TOTAL ROYAUME-UNI			15 019 986,89	4,01
SLOVENIE				
NOVA KREDITNA BANKA MARIBOR DD 1.875% 27-01-25	EUR	2 200 000	2 147 555,16	0,57
NOVA LJUBLJANSKA BANKA DD 6.0% 19-07-25	EUR	2 000 000	2 113 498,49	0,57
TOTAL SLOVENIE			4 261 053,65	1,14

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SUEDE				
CASTELLUM AB 3.125% PERP	EUR	2 000 000	1 436 124,86	0,38
DDM DEBT AB 9.0% 19-04-26	EUR	2 200 000	1 569 293,00	0,42
HEIMSTADEN AB 4.25% 09-03-26	EUR	1 400 000	780 963,94	0,21
HEIMSTADEN AB 4.375% 06-03-27	EUR	2 000 000	1 332 040,56	0,35
HEIMSTADEN AB 6.75% PERP	EUR	900 000	415 344,02	0,11
HOIST FINANCE AB	EUR	600 000	574 614,00	0,16
INTRUM AB 3.5% 15-07-26 EMTN	EUR	1 000 000	762 035,56	0,21
INTRUM AB 9.25% 15-03-28	EUR	2 800 000	2 451 416,28	0,65
TOTAL SUEDE			9 321 832,22	2,49
SUISSE				
JULIUS BAER GRUPPE AG 6.625% PERP	EUR	1 000 000	895 313,54	0,24
TOTAL SUISSE			895 313,54	0,24
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			346 340 723,05	92,45
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			346 340 723,05	92,45
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
R-CO CONVICTION SUBFIN I EUR	EUR	5 720	5 064 659,60	1,35
RMM COURT TERME C	EUR	1 739	6 904 734,28	1,84
TOTAL FRANCE			11 969 393,88	3,19
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			11 969 393,88	3,19
TOTAL Organismes de placement collectif			11 969 393,88	3,19
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
CBOE VIX FUT 0723	USD	185	-265 462,91	-0,07
FV CBOT UST 5 0923	USD	2 160	-1 913 821,55	-0,51
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			-2 179 284,46	-0,58
TOTAL Engagements à terme fermes			-2 179 284,46	-0,58
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				
CBA3M/0.0/FIX/3.7683	CAD	94 000 000	1 448 423,50	0,39
CHFOIS/0.0/FIX/0.985	CHF	50 000 000	1 585 252,58	0,42
E6R/0.0/FIX/1.984	EUR	10 750 000	1 167 813,11	0,31
FIX/1.6605/E6R/0.0	EUR	50 000 000	-3 058 838,75	-0,82
FIX/1.776/CHFOIS/0.0	CHF	10 750 000	290 518,98	0,07
FIX/2.05/NIBO6R/0.0	NOK	350 000 000	-3 815 934,93	-1,02
FIX/2.8211/SOFFRATE/	USD	17 000 000	-1 529 681,32	-0,41
FIX/3.6955/CBA3M/0.0	CAD	30 000 000	-269 173,58	-0,07
FIX/4.6375/CBA3M/0.0	CAD	97 000 000	-641 387,79	-0,17
NIBO6R/0.0/FIX/1.888	NOK	131 000 000	2 377 638,41	0,64
NIBO6R/0.0/FIX/3.31	NOK	190 000 000	-183 101,57	-0,05
SOFFRATE/0.0/FIX/2.6	USD	11 500 000	1 303 468,80	0,35
SOFFRATE/0.0/FIX/2.7	USD	4 250 000	257 191,34	0,07

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2023 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TOTAL Swaps de taux			-1 067 811,22	-0,29
Swaps d'inflation				
SWP INFLA 15042028	EUR	40 000 000	-668,38	0,00
SWP INFLA 15042028	EUR	40 000 000	350 443,67	0,09
SWP INFLA 15042028	EUR	40 000 000	-59 817,20	-0,01
SWP INFLA 15042028	EUR	40 000 000	343 654,09	0,09
TOTAL Swaps d'inflation			633 612,18	0,17
Credit Default Swap				
ITRAXX EUR XOVER S39	EUR	-20 000 000	-820 515,78	-0,22
ITRAXX EUR XOVER S39	EUR	-30 000 000	-1 234 940,33	-0,32
TOTAL Credit Default Swap			-2 055 456,11	-0,54
TOTAL Autres instruments financiers à terme			-2 489 655,15	-0,66
TOTAL Instrument financier à terme			-4 668 939,61	-1,24
Appel de marge				
APPEL MARGE R.M.M.	USD	2 368 010,51	2 179 284,47	0,58
TOTAL Appel de marge			2 179 284,47	0,58
Créances			26 728 536,39	7,13
Dettes			-28 290 842,05	-7,55
Comptes financiers			18 206 263,69	4,86
Actif net			374 624 419,82	100,00

Parts R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES C CHF H	CHF	5 800,0000	102,24
Parts R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES C EUR	EUR	1 420 190,7132	105,35
Parts R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES I EUR	EUR	209 620,0832	1 070,01
Parts R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES M EUR	EUR	7,5000	995,69
Parts R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES P CHF H	CHF	1 000,0000	102,68