

R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE

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	107 646 854,37
b) Avoirs bancaires	6 298 271,80
c) Autres actifs détenus par l'OPC	185 244,41
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	114 130 370,58
e) Passif	-2 305 770,21
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	111 824 600,37

* Les montants sont signés

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

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE C EUR en EUR	C	99 118 337,06	397 297,0152	249,48
R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE CL EUR en EUR	C	1 503 828,59	5 879,9018	255,76
R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE IC EUR en EUR	C	11 136 242,31	103,8791	107 203,88
R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE P EUR en EUR	C	66 192,41	73,0205	906,49

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.	85,11	83,39
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.	11,16	10,93
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.	0,00	0,00

* 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	87 590 090,96	78,33	76,75
Dollar Us	USD	10 869 152,46	9,72	9,52
Franc Suisse	CHF	5 836 504,46	5,22	5,11
Livre Sterling	GBP	3 351 106,49	3,00	2,94
TOTAL		107 646 854,37	96,26	94,32

* 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	34,54	33,84
ALLEMAGNE	16,02	15,70
ESPAGNE	10,65	10,43
PAYS-BAS	9,05	8,87
ITALIE	8,31	8,14
SUISSE	7,23	7,08
BELGIQUE	3,23	3,16
ROYAUME-UNI	3,00	2,94
LUXEMBOURG	2,28	2,23
MEXIQUE	0,93	0,91
AUTRICHE	0,73	0,71
SUEDE	0,30	0,29
TOTAL	96,26	94,32

* 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	0,00	0,00
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	0,00	0,00

* 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.	19 476 265,24	13 090 630,03
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.	1 241 605,23	3 985 645,91
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.	7 392 243,87	10 734 910,90

INFORMATION SUR LES FRAIS DE GESTION VARIABLES

	30/06/2023
Parts R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE 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
Parts R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE CL 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
Parts R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE IC 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
Parts R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE P 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

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2023 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2.0% 17-11-25 CV	EUR	2 700 000	3 125 597,48	2,80
DEUTSCHE POST AG 0.05% 30-06-25	EUR	1 500 000	1 458 769,62	1,30
HELLOFRESH SE 0.75% 13-05-25	EUR	1 600 000	1 481 271,65	1,33
LEG IMMOBILIEN AG 0.4% 30-06-28	EUR	600 000	450 722,07	0,40
LEG IMMOBILIEN AG 0.875% 01-09-25	EUR	2 800 000	2 511 158,01	2,24
MTU AERO ENGINES GMBH 0.05% 18-03-27	EUR	1 300 000	1 193 890,80	1,07
RAG STIFTUNG ZCP 17-06-26 CV	EUR	1 900 000	1 731 166,00	1,55
RHEINMETALL AG 1.875% 07-02-28	EUR	400 000	423 483,58	0,38
RHEINMETALL AG 2.25% 07-02-30	EUR	1 300 000	1 404 808,26	1,26
TAG IMMOBILIEN AG 0.625% 27-08-26	EUR	1 500 000	1 178 006,52	1,05
TUI AG 5.0% 16-04-28 CV	EUR	500 000	454 671,17	0,41
ZALANDO SE 0.625% 06-08-27 CV	EUR	3 100 000	2 503 141,29	2,23
TOTAL ALLEMAGNE			17 916 686,45	16,02
AUTRICHE				
VOESTALPHOL AG 2.75% 28-04-28	EUR	800 000	814 495,32	0,73
TOTAL AUTRICHE			814 495,32	0,73
BELGIQUE				
GROUPE BRUXELLES LAMBERT 2.125% 29-11-25	EUR	900 000	909 309,21	0,81
UMICORE ZCP 23-06-25 CV	EUR	3 000 000	2 702 280,00	2,42
TOTAL BELGIQUE			3 611 589,21	3,23
ESPAGNE				
AMADEUS CM 1.5% 09-04-25 CV	EUR	3 000 000	3 911 428,77	3,50
CELLNEX TELECOM 0.5% 05-07-28 CV	EUR	3 800 000	4 000 302,95	3,58
CELLNEX TELECOM 0.75% 20-11-31 CV	EUR	800 000	638 751,07	0,58
CELLNEX TELECOM 1.5% 16-01-26 CV	EUR	400 000	520 396,08	0,46
IBERDROLA FINANZAS SAU 0.8% 07-12-27 CV	EUR	900 000	901 435,65	0,81
INDR SIST 1.25% 07-10-23	EUR	1 000 000	996 185,46	0,89
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROU 1.125% 18-05-28	EUR	1 100 000	936 151,50	0,83
TOTAL ESPAGNE			11 904 651,48	10,65
FRANCE				
ACCOR 0.7% 07-12-27 CV	EUR	64 000	3 025 472,00	2,70
ATOS SE ZCP 06-11-24 CV	EUR	2 700 000	2 370 762,00	2,12
BNP PAR ZCP 13-05-25 CV	EUR	2 500 000	2 913 200,00	2,60
CARREFOUR ZCP 27-03-24 CV	USD	2 200 000	1 968 929,42	1,76
CIE GEN DES ETS MICHELIN ZCP 10-11-23	USD	1 800 000	1 615 834,10	1,44
CLARIANE 1.875% PERP CV	EUR	67 000	2 000 419,00	1,79
EDENRED ZCP 06-09-24 CV	EUR	13 000	841 847,50	0,75
EDENRED ZCP 14-06-28 CV	EUR	43 148	2 914 992,58	2,61
ELIS EX HOLDELIS 2.25% 22-09-29	EUR	800 000	1 005 950,79	0,90
FNAC DARTY 0.25% 23-03-27 CV	EUR	22 000	1 505 944,00	1,35
NEOEN 2.0% 02-06-25 CV	EUR	14 000	635 390,00	0,57
NEOEN 2.875% 14-09-27 CV	EUR	600 000	567 693,00	0,51
NEXITY 0.25% 02-03-25 CV	EUR	18 060	1 072 818,18	0,96
NEXITY 0.875% 19-04-28 CV	EUR	30 000	1 220 835,00	1,09

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ORPEA 0.375% 17-05-27 CV	EUR	13 000	542 490,00	0,49
SAFRAN 0.875% 15-05-27 CV	EUR	10 000	1 497 265,00	1,34
SAFRAN ZCP 01-04-28 CV	EUR	18 000	3 145 572,00	2,81
SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.0% 15-06-26	EUR	16 000	3 055 512,00	2,74
SELENA SARL ZCP 25-06-25 CV	EUR	6	558 705,00	0,50
SPIE 2.0% 17-01-28 CV	EUR	1 500 000	1 611 266,67	1,44
STS GROUP 8% 15/02/16 CONV. DEFAULT	EUR	340	0,00	0,00
UBISOFT ENTERTAINMENT 2.375% 15-11-28	EUR	700 000	716 415,58	0,64
VEOLIA ENVIRONNEMENT ZCP 01-01-25	EUR	70 000	2 256 765,00	2,02
WENDEL 2.625% 27-03-26 CV	EUR	1 600 000	1 582 160,66	1,41
TOTAL FRANCE			38 626 239,48	34,54
ITALIE				
DIASORIN ZCP 05-05-28 CV	EUR	1 600 000	1 245 664,00	1,11
NEXI 1.75% 24-04-27 CV	EUR	2 500 000	2 163 462,02	1,94
NEXI ZCP 24-02-28 CV	EUR	800 000	605 700,00	0,54
PIRELLI C ZCP 22-12-25 CV	EUR	1 800 000	1 729 728,00	1,55
PRYSMIAN 0.0000010% 02-02-26	EUR	3 300 000	3 550 404,00	3,17
TOTAL ITALIE			9 294 958,02	8,31
LUXEMBOURG				
ESPIRITO SANTO 3.125% 12/18 CV IN DEFAULT	EUR	4 700 000	0,00	0,00
LAGFIN SCA 3.5% 08-06-28 CV	EUR	1 400 000	1 425 971,87	1,28
OLIVER CAPITAL SARL ZCP 29-12-23	EUR	1 100 000	1 119 068,50	0,99
TOTAL LUXEMBOURG			2 545 040,37	2,27
MEXIQUE				
FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE 2.625% 24-02-26	EUR	1 000 000	1 043 294,32	0,94
TOTAL MEXIQUE			1 043 294,32	0,94
PAYS-BAS				
BASIC FIT NV 1.5% 17-06-28 CV	EUR	1 300 000	1 186 427,74	1,06
DUFREY ONE BV 0.75% 30-03-26 CV	CHF	2 400 000	2 190 215,67	1,96
JUST EAT TAKEAWAYCOM NV 0.625% 09-02-28	EUR	2 000 000	1 319 996,91	1,18
JUST EAT TAKEAWAYCOM NV 2.25% 25-01-24	EUR	2 600 000	2 576 599,35	2,31
QIAGEN NV 1.0% 13-11-24 CV	USD	1 400 000	1 382 017,72	1,23
QIAGEN NV ZCP 17-12-27 CV	USD	1 800 000	1 466 719,52	1,31
TOTAL PAYS-BAS			10 121 976,91	9,05
ROYAUME-UNI				
OCADO GROUP 0.75% 18-01-27 CV	GBP	2 200 000	1 795 100,30	1,61
WH SMITH 1.625% 07-05-26 CV	GBP	1 500 000	1 556 006,19	1,39
TOTAL ROYAUME-UNI			3 351 106,49	3,00
SUEDE				
FASTIGHETS AB BALDER 3.5% 23-02-28	EUR	400 000	334 875,83	0,30
TOTAL SUEDE			334 875,83	0,30
SUISSE				
SIKA AG 0.15% 05-06-25 CV	CHF	2 600 000	3 646 288,79	3,26
STMICROELECTRONICS NV ZCP 04-08-25	USD	3 200 000	3 545 723,19	3,17
STMICROELECTRONICS NV ZCP 04-08-27	USD	800 000	889 928,51	0,79
TOTAL SUISSE			8 081 940,49	7,22
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			107 646 854,37	96,26

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			107 646 854,37	96,26
Créances			185 244,41	0,17
Dettes			-2 305 770,21	-2,06
Comptes financiers			6 298 271,80	5,63
Actif net			111 824 600,37	100,00

Parts R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE C EUR	EUR	397 297,0152	249,48
Parts R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE CL EUR	EUR	5 879,9018	255,76
Parts R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE IC EUR	EUR	103,8791	107 203,88
Parts R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE P EUR	EUR	73,0205	906,49