

R-co Conviction Equity Value Euro

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 Conviction Equity Value Euro

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 214-24-49 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 Conviction Equity Value Euro 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 24 août 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 : FXR Devises Reuters

PORTEFEUILLE : 1457 R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO

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 |
|--|------------------------------|-------------------------------|------------|-------------------------------------|--------------|-----------------|--------|-----------------------------|--|-------------------|------------------------------|---------------------|
| SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | | | | CUMUL (EUR) | 544,271,727.25 | 582,194,481.78 | 0.00 | 37,922,754.53 93.83 |

III - Titres d'OPCVM

OPCVM européens coordonnés et assimilables

DEVISE VALEUR : EUR EURO

| | | | | | | | | | | | | |
|--------------|-------------------|-----------|-------|-----------|------------|---------|---|---------------|---------------|------|------------|------|
| FR0007442496 | RMM COURT TERME C | 9,685.032 | P EUR | 3951.3255 | M 29/06/23 | 3970.52 | 5 | 38,268,714.01 | 38,454,613.26 | 0.00 | 185,899.25 | 6.20 |
|--------------|-------------------|-----------|-------|-----------|------------|---------|---|---------------|---------------|------|------------|------|

VIII - TRESORERIE

Dettes et créances

Coupons et dividendes en espèces

DEVISE VALEUR : EUR EURO

| | | | | | | | | | | | | |
|--------------|------------------|----------|-------|------|----------|--|--|------------|------------|------|------|------|
| FR0000120271 | TOTALENERGIES SE | 595,244. | P EUR | 0.74 | 30/06/23 | | | 440,480.56 | 440,480.56 | 0.00 | 0.00 | 0.07 |
|--------------|------------------|----------|-------|------|----------|--|--|------------|------------|------|------|------|

DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

| | | | | | | | | | | | | |
|--------------|-------------------|----------|-------|-------|----------|--|--|-----------|-----------|------|-------|------|
| NL0000226223 | STMI CROELECTRONI | 304,360. | P USD | 0.039 | 30/06/23 | | | 10,880.96 | 10,879.96 | 0.00 | -1.00 | 0.00 |
|--------------|-------------------|----------|-------|-------|----------|--|--|-----------|-----------|------|-------|------|

Coupons et dividendes en espèces

| | | | | | | | | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|--|--|-------------|------------|------------|------|------------|
| | | | | | | | | CUMUL (EUR) | 451,361.52 | 451,360.52 | 0.00 | -1.00 0.07 |
|--|--|--|--|--|--|--|--|-------------|------------|------------|------|------------|

Frais de gestion

DEVISE VALEUR : EUR EURO

| | | | | | | | | | | | | |
|------------|-----------------------|-------------|-----|----|----------|----|--|-------------|-------------|------|------|-------|
| FGPFC2EUR | Frais de ges. var fig | -7,201.03 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -7,201.03 | -7,201.03 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| FGPFC7EUR | Frais de ges. var fig | -29,417.74 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -29,417.74 | -29,417.74 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| FGPFC8EUR | Frais de ges. var fig | -4,025.49 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -4,025.49 | -4,025.49 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| FGPFC9EUR | Frais de ges. var fig | -74,183.48 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -74,183.48 | -74,183.48 | 0.00 | 0.00 | -0.01 |
| FGPFD4EUR | Frais de ges. var fig | -8,395.53 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -8,395.53 | -8,395.53 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| FGPFD5EUR | Frais de ges. var fig | -250.39 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -250.39 | -250.39 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| FGPFD6EUR | Frais de ges. var fig | -2,356.8 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -2,356.80 | -2,356.80 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| FGPVFC1EUR | Frais de Gest. Fixe | -0.85 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -0.85 | -0.85 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| FGPVFC2EUR | Frais de Gest. Fixe | -39,441.45 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -39,441.45 | -39,441.45 | 0.00 | 0.00 | -0.01 |
| FGPVFC5EUR | Frais de Gest. Fixe | -151,128.43 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -151,128.43 | -151,128.43 | 0.00 | 0.00 | -0.02 |
| FGPVFC7EUR | Frais de Gest. Fixe | -191,036.7 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -191,036.70 | -191,036.70 | 0.00 | 0.00 | -0.03 |
| FGPVFC8EUR | Frais de Gest. Fixe | -23,756.01 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -23,756.01 | -23,756.01 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| FGPVFC9EUR | Frais de Gest. Fixe | -132,011.88 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -132,011.88 | -132,011.88 | 0.00 | 0.00 | -0.02 |
| FGPVFD4EUR | Frais de Gest. Fixe | -15,253.12 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -15,253.12 | -15,253.12 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| FGPVFD5EUR | Frais de Gest. Fixe | -7,723.29 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -7,723.29 | -7,723.29 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| FGPVFD6EUR | Frais de Gest. Fixe | -5,058.88 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -5,058.88 | -5,058.88 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

| | | | | | | | | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|--|--|-------------|-------------|-------------|------|------------|
| | | | | | | | | CUMUL (EUR) | -691,241.07 | -691,241.07 | 0.00 | 0.00 -0.11 |
|--|--|--|--|--|--|--|--|-------------|-------------|-------------|------|------------|

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : FXR Devises Reuters

PORTEFEUILLE : 1457 R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO

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 |
|---|------------------------------|-------------------------------|------------|-------------------------------------|--------------|-----------------|--------|------------------------------|--|-------------------|------------------------------|-----------------|
| Dettes et créances | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | CUMUL (EUR) | | | -239,879.55 | -239,880.55 | 0.00 | -1.00 | -0.04 |
| Disponibilités | | | | | | | | | | | | |
| Avoirs en france | | | | | | | | | | | | |
| DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE | | | | | | | | | | | | |
| BQRCCHF | ROTHSCHI LD MM | 4.74 | CHF | 0.91983122 | 30/06/23 | 1.02453768 | | 4.36 | 4.86 | 0.00 | 0.50 | 0.00 |
| DEVISE VALEUR : EUR EURO | | | | | | | | | | | | |
| BQRCEUR | ROTHSCHI LD MM | -125,608.09 | EUR | 1. | 30/06/23 | 1. | | -125,608.09 | -125,608.09 | 0.00 | 0.00 | -0.02 |
| DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING | | | | | | | | | | | | |
| BQRCGBP | ROTHSCHI LD MM | 4.5 | GBP | 1.10222222 | 30/06/23 | 1.16529744 | | 4.96 | 5.24 | 0.00 | 0.28 | 0.00 |
| DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US | | | | | | | | | | | | |
| BQRCUSD | ROTHSCHI LD MM | 193,780.63 | USD | 0.90309346 | 30/06/23 | 0.91659028 | | 175,002.02 | 177,617.44 | 0.00 | 2,615.42 | 0.03 |
| Avoirs en france | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | CUMUL (EUR) | | | 49,403.25 | 52,019.45 | 0.00 | 2,616.20 | 0.01 |
| VIII - TRESORERIE | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | CUMUL (EUR) | | | -190,476.30 | -187,861.10 | 0.00 | 2,615.20 | -0.03 |
| PORTEFEUILLE : R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO (1457) | | | | | | | | | | | | |
| | | | | | (EUR) | | | 582,349,964.96 | 620,461,233.94 | 0.00 | 38,111,268.98 | 100.00 |

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : FXR Devises Reuters

PORTEFEUILLE : 1457 R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

Portefeuille titres : 620,649,095.04 Coupons et dividendes a recevoir : 451,360.52

Frais de gestion du jour

| | | |
|-----------------------|----------|-----|
| Frais de Gest. Fixe : | 4,893.04 | EUR |
| Frais de Gest. Fixe : | 6,569.53 | EUR |
| Frais de Gest. Fixe : | 453.67 | EUR |
| Frais de Gest. Fixe : | 4,448.27 | EUR |
| Frais de Gest. Fixe : | 515.88 | EUR |
| Frais de Gest. Fixe : | 170.25 | EUR |
| Frais de Gest. Fixe : | 0.03 | EUR |
| Frais de Gest. Fixe : | 1,296.06 | EUR |
| Frais de Gest. Fixe : | 264.49 | EUR |

Frais de gestion charge Entreprise

| | | |
|-----------------|----------|-----|
| FRAIS MAXIMUM : | 0.03 | EUR |
| FRAIS MAXIMUM : | 1,296.06 | EUR |
| FRAIS MAXIMUM : | 4,893.04 | EUR |
| FRAIS MAXIMUM : | 6,569.53 | EUR |
| FRAIS MAXIMUM : | 453.67 | EUR |
| FRAIS MAXIMUM : | 4,448.27 | EUR |
| FRAIS MAXIMUM : | 515.88 | EUR |
| FRAIS MAXIMUM : | 264.49 | EUR |
| FRAIS MAXIMUM : | 170.25 | EUR |

| Part | Devise | Actif net | Nombre de parts | Valeur liquidative | Coefficient | Coeff resultat | Change | Prix std Souscript. | Prix std Rachat |
|--|--------|----------------|-----------------|--------------------|-----------------|----------------|--------|---------------------|-----------------|
| C1 FR0011845411 R-CO CVICT EQ VAL M EUR | | 941,527.31 | 631.59 | 1,490.73 | 0.15174180944 | | | 1,565.27 | 1,490.73 |
| C2 FR0011845429 R-CO CVICT EQ VAL P EUR | | 49,794,654.39 | 35,421.3706 | 1,405.78 | 8.025393707295 | | | 1,469.04 | 1,405.78 |
| C5 FR0013294006 R-CO CVICT EQ VAL CL EUR | | 142,871,994.64 | 635,060.133 | 224.97 | 23.026837824447 | | | 235.09 | 224.97 |
| C7 FR0010187898 R-CO CVICT EQ VAL C EUR | | 159,851,970.48 | 727,478.468 | 219.73 | 25.763695833422 | | | 229.62 | 219.73 |
| C8 FR0010807099 R-CO CVICT EQ VAL F EUR | | 8,714,806.47 | 42,091.8477 | 207.04 | 1.404600037525 | | | 216.36 | 207.04 |
| C9 FR0010839555 R-CO CVICT EQ VAL I EUR | | 216,478,037.02 | 1,137.4595 | 190,317.14 | 34.889527352656 | | | 198,881.41 | 190,317.14 |
| D4 FR0011418342 R-CO CVICT EQ VAL ID EUR | | 25,105,523.57 | 166.5 | 150,783.93 | 4.046229647573 | | | 157,569.21 | 150,783.93 |
| D5 FR0013076411 R-CO CVICT EQ VAL PB EUR | | 10,161,559.77 | 10,234. | 992.92 | 1.637736397369 | | | 1,037.60 | 992.92 |
| D6 FR0013294022 R-CO CVICT EQ VAL MF EUR | | 6,541,160.29 | 5,752.3223 | 1,137.13 | 1.054237390273 | | | 1,188.30 | 1,137.13 |
| C4 FR0013111754 R-CO CVICT EQ VAL R EUR | | 0.00 | 0. | 10.00 | 0. | | | 0.00 | 0.00 |

Actif net total en EUR : 620,461,233.94

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock adm principal au 30/06/23

Devise de fixing : FXR Devises Reuters

PORTEFEUILLE : 1457 R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

Precedente VL en date du 29/06/23 :

| | | | | | | |
|----|----------------------|------------|------------|-------|-------------|---------|
| C1 | R-CO CVICT EQ VAL M | Prec. VL : | 1,477.09 | (EUR) | Variation : | +0.923% |
| C2 | R-CO CVICT EQ VAL P | Prec. VL : | 1,392.96 | (EUR) | Variation : | +0.920% |
| C5 | R-CO CVICT EQ VAL CL | Prec. VL : | 222.92 | (EUR) | Variation : | +0.920% |
| C7 | R-CO CVICT EQ VAL C | Prec. VL : | 217.73 | (EUR) | Variation : | +0.919% |
| C8 | R-CO CVICT EQ VAL F | Prec. VL : | 205.16 | (EUR) | Variation : | +0.916% |
| C9 | R-CO CVICT EQ VAL I | Prec. VL : | 188,580.03 | (EUR) | Variation : | +0.921% |
| D4 | R-CO CVICT EQ VAL ID | Prec. VL : | 149,407.66 | (EUR) | Variation : | +0.921% |
| D5 | R-CO CVICT EQ VAL PB | Prec. VL : | 983.86 | (EUR) | Variation : | +0.921% |
| D6 | R-CO CVICT EQ VAL MF | Prec. VL : | 1,126.76 | (EUR) | Variation : | +0.920% |

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : FXR Devises Reuters

PORTEFEUILLE : 1457 R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

COURS DES DEVICES UTILISEES

| | par la valorisation | | par l'inventaire | | par la valorisation précédente | variation | | |
|--------------------|---------------------|------------|------------------|----|--------------------------------|------------|----------|----------|
| Cours EUR en CHF : | 0.97605 | cotation : | 30/06/23 | 0. | 0.9768 | cotation : | 29/06/23 | -0.07678 |
| Cours EUR en EUR : | 1. | cotation : | 30/06/23 | 0. | 1. | cotation : | 29/06/23 | 0. |
| Cours EUR en GBP : | 0.85815 | cotation : | 30/06/23 | 0. | 0.86295 | cotation : | 29/06/23 | -0.55623 |
| Cours EUR en USD : | 1.091 | cotation : | 30/06/23 | 0. | 1.08885 | cotation : | 29/06/23 | 0.19746 |

COURS INVERSES DES DEVICES UTILISEES

| | par la valorisation | | par l'inventaire | | par la valorisation précédente | | |
|--------------------|---------------------|------------|------------------|----|--------------------------------|------------|----------|
| Cours CHF en EUR : | 1.0245376773 | cotation : | 30/06/23 | 0. | 1.0237510237 | cotation : | 29/06/23 |
| Cours EUR en EUR : | 1. | cotation : | 30/06/23 | 0. | 1. | cotation : | 29/06/23 |
| Cours GBP en EUR : | 1.1652974421 | cotation : | 30/06/23 | 0. | 1.1588156903 | cotation : | 29/06/23 |
| Cours USD en EUR : | 0.9165902841 | cotation : | 30/06/23 | 0. | 0.9184001469 | cotation : | 29/06/23 |

R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO

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 | 582 194 481,78 |
| b) Avoirs bancaires | 177 627,54 |
| c) Autres actifs détenus par l'OPC | 38 905 973,78 |
| d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c) | 621 278 083,10 |
| e) Passif | -816 849,16 |
| f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC) | 620 461 233,94 |

* 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 CONVICTION EQUITY VALUE EURO C EUR en EUR | C | 159 851 970,48 | 727 478,4680 | 219,73 |
| R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO CL EUR en EUR | C | 142 871 994,64 | 635 060,1330 | 224,97 |
| R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO F EUR en EUR | C | 8 714 806,47 | 42 091,8477 | 207,04 |
| R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO ID EUR en EUR | D | 25 105 523,57 | 166,5000 | 150 783,93 |
| R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO I EUR en EUR | C | 216 478 037,02 | 1 137,4595 | 190 317,14 |
| R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO M EUR en EUR | C | 941 527,31 | 631,5900 | 1 490,73 |
| R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO MF EUR en EUR | D | 6 541 160,29 | 5 752,3223 | 1 137,13 |
| R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO PB EUR en EUR | D | 10 161 559,77 | 10 234,0000 | 992,92 |
| R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO P EUR en EUR | C | 49 794 654,39 | 35 421,3706 | 1 405,78 |

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. | 89,23 | 89,11 |
| 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. | 4,61 | 4,60 |
| 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. | 6,20 | 6,19 |

* 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 | 582 194 481,78 | 93,83 | 93,71 |
| TOTAL | | 582 194 481,78 | 93,83 | 93,71 |

* 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 | 41,31 | 41,25 |
| ALLEMAGNE | 17,87 | 17,85 |
| ITALIE | 9,45 | 9,44 |
| PAYS-BAS | 6,32 | 6,32 |
| ESPAGNE | 4,29 | 4,29 |
| ROYAUME-UNI | 2,37 | 2,37 |
| SUISSE | 2,24 | 2,23 |
| PORTUGAL | 1,99 | 1,99 |
| IRLANDE | 1,96 | 1,96 |
| BELGIQUE | 1,79 | 1,79 |
| LUXEMBOURG | 1,79 | 1,79 |
| FINLANDE | 1,35 | 1,35 |
| AUTRICHE | 1,09 | 1,09 |
| TOTAL | 93,83 | 93,71 |

* 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 | 6,20 | 6,19 |
| 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 | 6,20 | 6,19 |

* 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. | 106 745 542,12 | 232 038 048,26 |
| 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. | 20 202 239,54 | 7 950 296,35 |
| 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. | 147 428 766,79 | 118 463 683,22 |

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

| | Action | Montant net unitaire EUR | Crédit d'impôt EUR | Montant brut unitaire EUR |
|----------------------------|---|-----------------------------|-----------------------|---------------------------------|
| Dividendes versés | | | | |
| 05/05/2023 | R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO MF EUR | 25,49 | 4,725 | 30,215 |
| 05/05/2023 | R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO ID EUR | 3 505,31 | 564,598 | 4 069,908 |
| 05/05/2023 | R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO PB EUR | 27,10 | 3,448 | 30,548 |
| Dividendes à verser | | | | |
| | R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO ID EUR | | | |
| | R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO MF EUR | | | |
| | R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO PB EUR | | | |

INFORMATION SUR LES FRAIS DE GESTION VARIABLES

| | 30/06/2023 |
|--|------------|
| Action R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO C EUR | |
| Frais de gestion variables provisionnés | 0,00 |
| Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés | 0,00 |
| Frais de gestion variables acquis | 29 417,74 |
| Pourcentage de frais de gestion variables acquis | 0,04 |
| Action R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO 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 |
| Action R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO F EUR | |
| Frais de gestion variables provisionnés | 0,00 |
| Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés | 0,00 |
| Frais de gestion variables acquis | 4 025,49 |
| Pourcentage de frais de gestion variables acquis | 0,02 |
| Action R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO ID EUR | |
| Frais de gestion variables provisionnés | 0,00 |
| Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés | 0,00 |
| Frais de gestion variables acquis | 8 395,53 |
| Pourcentage de frais de gestion variables acquis | 0,07 |
| Action R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO I EUR | |
| Frais de gestion variables provisionnés | 0,00 |
| Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés | 0,00 |
| Frais de gestion variables acquis | 74 183,48 |
| Pourcentage de frais de gestion variables acquis | 0,06 |
| Action R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO 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 CONVICTION EQUITY VALUE EURO MF EUR | |
| Frais de gestion variables provisionnés | 0,00 |
| Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés | 0,00 |
| Frais de gestion variables acquis | 2 356,80 |
| Pourcentage de frais de gestion variables acquis | 0,07 |

« 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. »

INFORMATION SUR LES FRAIS DE GESTION VARIABLES (suite)

| | 30/06/2023 |
|--|------------|
| Action R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO PB EUR | |
| Frais de gestion variables provisionnés | 0,00 |
| Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés | 0,00 |
| Frais de gestion variables acquis | 182,69 |
| Pourcentage de frais de gestion variables acquis | 0,00 |
| Action R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO P EUR | |
| Frais de gestion variables provisionnés | 0,00 |
| Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés | 0,00 |
| Frais de gestion variables acquis | 7 201,03 |
| Pourcentage de frais de gestion variables acquis | 0,02 |

« 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 |
|---|--------|---------------------|-----------------------|--------------|
| Actions et valeurs assimilées | | | | |
| Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé | | | | |
| ALLEMAGNE | | | | |
| BASF SE | EUR | 244 617 | 10 878 117,99 | 1,75 |
| DEUTSCHE POST AG NAMEN | EUR | 290 603 | 12 998 672,19 | 2,09 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG | EUR | 872 031 | 17 419 691,26 | 2,81 |
| HENKEL AG AND CO.KGAA NON VTG PRF | EUR | 132 340 | 9 695 228,40 | 1,56 |
| MERCEDES BENZ GROUP AG REGISTERED SHARES | EUR | 174 178 | 12 831 693,26 | 2,07 |
| PROSIEBEN SAT.1 MEDIA N | EUR | 1 086 962 | 9 284 829,40 | 1,49 |
| SIEMENS AG-REG | EUR | 146 224 | 22 305 008,96 | 3,60 |
| VONOVIA SE | EUR | 863 589 | 15 453 925,16 | 2,49 |
| TOTAL ALLEMAGNE | | | 110 867 166,62 | 17,86 |
| AUTRICHE | | | | |
| WIENERBERGER AG | EUR | 241 070 | 6 759 602,80 | 1,09 |
| TOTAL AUTRICHE | | | 6 759 602,80 | 1,09 |
| BELGIQUE | | | | |
| ANHEUSER BUSCH INBEV SA/NV | EUR | 214 588 | 11 122 096,04 | 1,79 |
| TOTAL BELGIQUE | | | 11 122 096,04 | 1,79 |
| ESPAGNE | | | | |
| BANKINTER SA | EUR | 1 114 058 | 6 272 146,54 | 1,01 |
| CAIXABANK S.A. | EUR | 2 060 798 | 7 804 242,03 | 1,26 |
| INDITEX | EUR | 353 877 | 12 548 478,42 | 2,02 |
| TOTAL ESPAGNE | | | 26 624 866,99 | 4,29 |
| FINLANDE | | | | |
| NOKIA (AB) OYJ | EUR | 2 198 505 | 8 402 686,11 | 1,36 |
| TOTAL FINLANDE | | | 8 402 686,11 | 1,36 |
| FRANCE | | | | |
| ALSTOM | EUR | 453 659 | 12 393 963,88 | 2,00 |
| AMUNDI | EUR | 121 496 | 6 566 858,80 | 1,06 |
| AXA | EUR | 636 134 | 17 191 521,35 | 2,77 |
| BNP PARIBAS | EUR | 418 609 | 24 162 111,48 | 3,89 |
| CAPGEMINI SE | EUR | 99 847 | 17 328 446,85 | 2,80 |
| CARREFOUR | EUR | 664 775 | 11 537 170,13 | 1,85 |
| DANONE | EUR | 267 288 | 15 005 548,32 | 2,42 |
| EIFFAGE | EUR | 80 728 | 7 715 982,24 | 1,25 |
| FAURECIA EX BERTRAND FAURE | EUR | 251 513 | 5 425 135,41 | 0,88 |
| ORANGE | EUR | 1 144 707 | 12 250 654,31 | 1,98 |
| SAINT-GOBAIN | EUR | 233 753 | 13 027 054,69 | 2,10 |
| SANOFI | EUR | 384 750 | 37 782 450,00 | 6,08 |
| SOCIETE GENERALE SA | EUR | 891 865 | 21 226 387,00 | 3,42 |
| TECHNIP ENERGIES NV | EUR | 497 686 | 10 506 151,46 | 1,69 |
| TOTALENERGIES SE | EUR | 589 910 | 30 999 770,50 | 5,00 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | EUR | 455 381 | 13 183 279,95 | 2,12 |
| TOTAL FRANCE | | | 256 302 486,37 | 41,31 |
| IRLANDE | | | | |
| RYANAIR HOLDINGS PLC | EUR | 707 858 | 12 185 775,47 | 1,96 |
| TOTAL IRLANDE | | | 12 185 775,47 | 1,96 |

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

| Désignation des valeurs | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle | % Actif Net |
|--|--------|---------------------|-----------------------|---------------|
| ITALIE | | | | |
| ASSICURAZIONI GENERALI | EUR | 594 947 | 11 077 913,14 | 1,79 |
| ENI SPA | EUR | 1 252 715 | 16 513 289,13 | 2,67 |
| INTESA SANPAOLO | EUR | 8 170 148 | 19 608 355,20 | 3,16 |
| UNICREDIT SPA | EUR | 538 995 | 11 461 728,68 | 1,84 |
| TOTAL ITALIE | | | 58 661 286,15 | 9,46 |
| LUXEMBOURG | | | | |
| ARCELORMITTAL | EUR | 445 904 | 11 116 386,72 | 1,79 |
| TOTAL LUXEMBOURG | | | 11 116 386,72 | 1,79 |
| PAYS-BAS | | | | |
| AIRBUS SE | EUR | 75 083 | 9 937 985,88 | 1,60 |
| KONINKLIJKE KPN NV | EUR | 3 404 689 | 11 129 928,34 | 1,80 |
| SIGNIFY NV | EUR | 294 190 | 7 551 857,30 | 1,22 |
| STELLANTIS NV | EUR | 660 307 | 10 617 736,56 | 1,71 |
| TOTAL PAYS-BAS | | | 39 237 508,08 | 6,33 |
| PORTUGAL | | | | |
| ELEC DE PORTUGAL | EUR | 2 756 082 | 12 336 223,03 | 1,99 |
| TOTAL PORTUGAL | | | 12 336 223,03 | 1,99 |
| ROYAUME-UNI | | | | |
| COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNE | EUR | 249 326 | 14 710 234,00 | 2,37 |
| TOTAL ROYAUME-UNI | | | 14 710 234,00 | 2,37 |
| SUISSE | | | | |
| STMICROELECTRONICS NV | EUR | 304 360 | 13 868 163,40 | 2,23 |
| TOTAL SUISSE | | | 13 868 163,40 | 2,23 |
| TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé | | | 582 194 481,78 | 93,83 |
| TOTAL Actions et valeurs assimilées | | | 582 194 481,78 | 93,83 |
| Organismes de placement collectif | | | | |
| OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays | | | | |
| FRANCE | | | | |
| RMM COURT TERME C | EUR | 9 685,032 | 38 454 613,26 | 6,20 |
| TOTAL FRANCE | | | 38 454 613,26 | 6,20 |
| TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays | | | 38 454 613,26 | 6,20 |
| TOTAL Organismes de placement collectif | | | 38 454 613,26 | 6,20 |
| Créances | | | 451 360,52 | 0,07 |
| Dettes | | | -691 241,07 | -0,11 |
| Comptes financiers | | | 52 019,45 | 0,01 |
| Actif net | | | 620 461 233,94 | 100,00 |

| | | | |
|--|-----|--------------|------------|
| Parts R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO C EUR | EUR | 727 478,4680 | 219,73 |
| Parts R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO CL EUR | EUR | 635 060,1330 | 224,97 |
| Parts R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO F EUR | EUR | 42 091,8477 | 207,04 |
| Parts R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO ID EUR | EUR | 166,5000 | 150 783,93 |
| Parts R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO I EUR | EUR | 1 137,4595 | 190 317,14 |
| Parts R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO M EUR | EUR | 631,5900 | 1 490,73 |
| Parts R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO MF EUR | EUR | 5 752,3223 | 1 137,13 |
| Parts R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO PB EUR | EUR | 10 234,0000 | 992,92 |

| | | | |
|---|-----|-------------|----------|
| Parts R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO P EUR | EUR | 35 421,3706 | 1 405,78 |
|---|-----|-------------|----------|