

# **R-co Conviction Credit SD 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 Credit SD 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 214-17 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 Conviction Credit SD 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 GAILLENNE

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1654 R-CO CONVICTION CREDIT SD 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
-------------	------------------------------	-------------------------------	------------	-----------------------------------	--------------	-----------------	--------	------------------------------	--	-------------------	------------------------------	-----------------

0 - Actions & Valeurs assimilées

Actions & valeurs assimilées négo. sur un marché réglementé

Actions & valeurs ass. ng. sur un marché regl. ou as

DEVISE VALEUR : EUR EURO

ES0105200002	ABENGOA CL B	947,069.	P EUR	0.	M 24/05/22	0.	V	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
ES0105200416	ABENGOA SA	91,590.	P EUR	0.	M 24/05/22	0.	V	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
DE0006949555	HYPO ALPE 7.375%PREF	3,100.	P EUR	59.	M 17/06/19	0.	V	182,900.00	0.00	0.00	-182,900.00	0.00
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO												
CUMUL (EUR)								182,900.00	0.00	0.00	-182,900.00	

DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

US3135867527	FNMA 8.25% ACT. PREF.	40,000.	P USD	0.72	M 30/06/23	0.	E	21,793.42	0.00	0.00	-21,793.42	0.00
--------------	-----------------------	---------	-------	------	------------	----	---	-----------	------	------	------------	------

I - Obligations & Valeurs assimilées

Obligations & valeurs assimilées négociés sur un marché réglementé

Obligations à taux fixe négo. sur un marché regl.

DEVISE VALEUR : EUR EURO

ES0365936048	ABAN CO 5.5 05-26	(366) 180526	2,700,000.	M EUR	99.76	% 30/06/23	99.443	4	2,693,520.00	2,704,030.67	19,069.67	10,510.67	0.62
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	0.78
DE000A254YS5	ACCE RE 3.625 02-26	(UST) 130226	2,500,000.	M EUR	99.3463	% 30/06/23	60.649	4	2,235,292.49	1,413,898.94	49,296.44	-821,393.55	0.33
XS2292486771	ACEA 0.0 09-25	(366) 280925	2,000,000.	M EUR	100.177	% 30/06/23	91.0245	4	2,003,540.00	1,820,490.00	0.00	-183,050.00	0.42
XS1622421722	AKEL RE 1.75 02-25	(366) 070225	2,083,000.	M EUR	107.6698	% 30/06/23	93.5445	4	2,242,762.80	1,963,212.80	14,680.87	-279,550.00	0.45
XS2243983520	ALD 0.375 10-23	(366) 191023	2,100,000.	M EUR	99.955	% 30/06/23	98.987	4	2,099,055.00	2,084,293.44	5,566.44	-14,761.56	0.48
XS2451372499	ALD 1.25 03-26	(366) 020326	2,500,000.	M EUR	93.073	% 30/06/23	92.4755	4	2,326,824.45	2,322,474.93	10,587.43	-4,349.52	0.54
FR001400D7MO	ALD 4.75 10-25	(366) 131025	1,600,000.	M EUR	99.959	% 30/06/23	100.8975	4	1,599,344.00	1,669,329.86	54,969.86	69,985.86	0.39
DE000A1YCQ29	ALLIANZ 4.75% 311249	(366) 311299	4,000,000.	M EUR	103.0582	% 30/06/23	99.8535	4	4,122,328.77	4,125,838.63	131,698.63	3,509.86	0.95
XS2537060746	ARCE MI 4.875 09-26	(366) 260926	4,350,000.	M EUR	101.1302	% 30/06/23	102.11	4	4,399,161.75	4,605,044.08	163,259.08	205,882.33	1.06
BE6339428904	ARGE SP 5.375 11-27	(366) 291127	4,000,000.	M EUR	103.5664	% 30/06/23	99.6305	4	4,142,657.53	4,113,041.92	127,821.92	-29,615.61	0.95
FR001400CSG4	ARVA SE 4.0 09-26	(366) 220926	6,300,000.	M EUR	99.801	% 30/06/23	98.8605	4	6,287,463.00	6,424,978.62	196,767.12	137,515.62	1.48
XS1528093799	AUTO PE 1.75 02-27	(366) 010227	5,000,000.	M EUR	93.0404	% 30/06/23	91.337	4	4,652,020.55	4,603,528.08	36,678.08	-48,492.47	1.06
XS2081611993	AZIMUT 1.625 12-24	(366) 121224	3,400,000.	M EUR	99.838	% 30/06/23	96.1915	4	3,394,492.00	3,301,390.45	30,879.45	-93,101.55	0.76
XS1079726334	BAC 2 3/8 06/19/24	(EXA) 190624	3,000,000.	M EUR	110.6427	% 30/06/23	98.4165	4	3,319,281.15	2,955,415.08	2,920.08	-363,866.07	0.68
XS2028816028	BANC DE 0.875 07-25	(366) 220725	5,000,000.	M EUR	102.6664	% 30/06/23	92.802	4	5,133,321.92	4,681,692.47	41,592.47	-451,629.45	1.08
XS2545425980	BANC ME 5.035 01-27	(366) 220127	2,100,000.	M EUR	99.994	% 30/06/23	101.0975	4	2,099,874.00	2,170,266.14	47,218.64	70,392.14	0.50
XS1987142673	BANK OF 0.5 04-24	(366) 300424	3,000,000.	M EUR	99.99	% 30/06/23	97.143	4	2,999,700.00	2,916,953.93	2,663.93	-82,746.07	0.67
XS0909359332	BATSLN 2.75 03/25/25	(EXA) 250325	4,000,000.	M EUR	110.0432	% 30/06/23	97.3125	4	4,401,726.03	3,922,855.19	30,355.19	-478,870.84	0.91
XS2620201421	BBVA 4.125 05-26	(366) 100526	5,900,000.	M EUR	99.928	% 30/06/23	99.1665	4	5,895,752.00	5,887,396.25	36,572.75	-8,355.75	1.36
ES0213211131	BBVA 6.2 07-23	(366) 040723	1,100,000.	M EUR	120.8578	% 30/06/23	100.	R	1,329,435.89	1,100,000.00	0.00	-229,435.89	0.25
PTBCPBOM0062	BCP 8.5 10-25	(366) 271025	1,800,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	103.506	4	1,800,000.00	1,968,740.88	105,632.88	168,740.88	0.45
XS1288858548	BFCM 3.0 09-25	(366) 110925	1,900,000.	M EUR	104.2781	% 30/06/23	97.0925	4	1,981,283.56	1,890,982.16	46,224.66	-90,301.40	0.44
FR0014002557	BFCM BA 0.01 05-26	(366) 110526	2,000,000.	M EUR	89.0994	% 30/06/23	88.9365	4	1,781,987.95	1,778,759.51	29.51	-3,228.44	0.41
XS2465984289	BK IREL 1.875 06-26	(366) 050626	4,000,000.	M EUR	94.6717	% 30/06/23	94.244	4	3,786,868.85	3,775,702.62	5,942.62	-11,166.23	0.87
XS2051670136	BLAC PR 0.5 09-23	(366) 120923	2,750,000.	M EUR	100.0468	% 30/06/23	98.935	4	2,751,286.28	2,731,825.51	11,113.01	-19,460.77	0.63
FR0013299641	BNP PAR 1.0 11-24	(366) 291124	3,500,000.	M EUR	102.6875	% 30/06/23	95.2635	4	3,594,063.70	3,355,030.72	20,808.22	-239,032.98	0.77
XS1823532640	BNP PAR 1.125 11-23	(366) 221123	4,300,000.	M EUR	104.402	% 30/06/23	98.9935	4	4,489,287.14	4,286,408.17	29,687.67	-202,878.97	0.99
FR0013398070	BNP PAR 2.125 01-27	(366) 230127	1,500,000.	M EUR	94.9841	% 30/06/23	93.773	4	1,424,761.64	1,420,742.26	14,147.26	-4,019.38	0.33

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1654 R-CO CONVICTION CREDIT SD 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 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	
FR0013179223 BPCE 3.0 07-26	(UST)	170726	2,000,000.	M EUR	105.9083	% 30/06/23	96.083	E	2,118,166.67	1,934,187.47	12,527.47	-183,979.20	0.45
FR001400C019 BPCE 3.5 10-27	(UST)	281027	1,100,000.	M EUR	98.3846	% 30/06/23	97.2535	E	1,082,230.77	1,076,875.04	7,086.54	-5,355.73	0.25
FR001400HACO BPCE 3.625 04-26	(366)	170426	2,300,000.	M EUR	99.64	% 30/06/23	98.4375	E	2,291,720.00	2,281,830.94	17,768.44	-9,889.06	0.53
FR0011538222 BPCE 4.625% 18/07/23	(366)	180723	2,000,000.	M EUR	117.7777	% 30/06/23	100.0075	4	2,355,553.00	2,089,102.05	88,952.05	-266,450.95	0.48
FR0013286838 BQ POST 1.0 10-24	(366)	161024	1,000,000.	M EUR	96.1548	% 30/06/23	96.0105	4	961,547.95	967,255.68	7,150.68	5,707.73	0.22
FR0013201118 BURE VE 2.0 09-26	(366)	070926	1,700,000.	M EUR	92.9041	% 30/06/23	92.4845	E	1,579,369.86	1,600,181.71	27,945.21	20,811.85	0.37
FR0013030129 CA 3.0 12-25	(UST)	211225	1,500,000.	M EUR	110.69	% 30/06/23	96.488	E	1,660,350.00	1,448,909.67	1,589.67	-211,440.33	0.33
XS2633552026 CA AUTO 4.375 06-26	(366)	080626	4,400,000.	M EUR	99.772	% 30/06/23	100.0235	4	4,389,968.00	4,414,708.86	13,674.86	24,740.86	1.02
PTCCCOMOM0006 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	0.53
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	0.67
XS2356316872 CECO AG 1.75 06-26	(366)	240626	6,400,000.	M EUR	99.409	% 30/06/23	78.5515	4	6,362,176.00	5,030,356.11	3,060.11	-1,331,819.89	1.16
XS1492691008 CELA US 1.125 09-23	(366)	260923	1,199,000.	M EUR	103.1534	% 30/06/23	99.296	4	1,236,809.56	1,200,943.53	10,384.49	-35,866.03	0.28
XS2497520705 CELA US 4.777 07-26	(366)	190726	3,450,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	97.697	4	3,450,000.00	3,528,580.13	158,033.63	78,580.13	0.82
XS2465792294 CELL FI 2.25 04-26	(366)	120426	3,300,000.	M EUR	98.932	% 30/06/23	93.879	4	3,264,756.00	3,114,845.11	16,838.11	-149,910.89	0.72
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	0.56
XS2468979302 CETI FI 3.125 04-27	(366)	140427	3,700,000.	M EUR	99.495	% 30/06/23	92.557	4	3,681,315.00	3,450,198.14	25,589.14	-231,116.86	0.80
DE000CZ40LR5 CMZB 0 1/2 09/13/23	(EXA)	130923	2,300,000.	M EUR	102.2217	% 30/06/23	99.385	4	2,351,099.45	2,295,118.01	9,263.01	-55,981.44	0.53
XS2264980363 CNH IND 0.0 04-24	(366)	010424	3,200,000.	M EUR	99.91	% 30/06/23	97.0065	4	3,197,120.00	3,104,208.00	0.00	-92,912.00	0.72
XS1678966935 CNH IND 1.75 09-25	(366)	120925	1,000,000.	M EUR	107.3826	% 30/06/23	95.4135	4	1,073,826.03	968,278.84	14,143.84	-105,547.19	0.22
XS2178585423 CONT GU 2.125 11-23	(366)	271123	2,400,000.	M EUR	99.559	% 30/06/23	99.2955	4	2,389,416.00	2,413,692.00	30,600.00	24,276.00	0.56
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	0.84
XS1698714000 COVI SA 1.625 10-24	(366)	171024	400,000.	M EUR	106.2295	% 30/06/23	96.6185	4	424,917.81	391,104.14	4,630.14	-33,813.67	0.09
FR0013134897 CRED AGR 2.85 04-26	(UST)	270426	4,000,000.	M EUR	110.9574	% 30/06/23	95.6655	4	4,438,297.80	3,847,916.70	21,296.70	-590,381.10	0.89
FR0013173028 CRED MUT 3.25 06-26	(366)	010626	1,700,000.	M EUR	114.3658	% 30/06/23	96.174	4	1,944,217.81	1,639,939.56	4,981.56	-304,278.25	0.38
BE0002872530 CRELAN 5.375 10-25	(366)	311025	4,200,000.	M EUR	99.707	% 30/06/23	99.545	E	4,187,694.00	4,333,039.32	152,149.32	145,345.32	1.00
XS2264194205 CTP BV	(366)	271123	3,000,000.	M EUR	101.3522	% 30/06/23	98.027	4	3,040,564.93	2,952,060.00	11,250.00	-88,504.93	0.68
XS2046595836 DANS BK 0.5 08-25	(366)	270825	4,000,000.	M EUR	95.5024	% 30/06/23	95.069	4	3,820,094.79	3,819,801.10	17,041.10	-293.69	0.88
XS2408458227 DEUT LU 1.625 11-23	(366)	161123	2,200,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	98.9895	4	2,200,000.00	2,200,296.40	22,527.40	296.40	0.51
XS2363244513 DEUT LU 2.0 07-24	(366)	140724	3,900,000.	M EUR	99.283	% 30/06/23	97.67	4	3,872,037.00	3,884,993.01	75,863.01	12,956.01	0.90
DE000A30WV1 DEUT PF 4.375 08-26	(366)	280826	4,400,000.	M EUR	99.921	% 30/06/23	98.046	4	4,396,524.00	4,476,989.75	162,965.75	80,465.75	1.03
XS0399353506 EDP FIN ZCP 11-23	(999)	121123	2,000,000.	M EUR	98.95	% 30/06/23	98.425	E	1,979,000.00	1,968,500.00	0.00	-10,500.00	0.45
XS2540585564 ELEC AB 4.125 10-26	(366)	051026	1,800,000.	M EUR	99.491	% 30/06/23	100.3675	4	1,790,838.00	1,861,946.51	55,331.51	71,108.51	0.43
BE6279619330 ETHI VIE 5.0 01-26	(366)	140126	5,200,000.	M EUR	111.3198	% 30/06/23	100.512	4	5,788,630.14	5,348,432.22	121,808.22	-440,197.92	1.24
XS1651444140 EURO SC 2.125 07-24	(366)	250724	990,000.	M EUR	101.4702	% 30/06/23	97.81	4	1,004,555.03	988,146.12	19,827.12	-16,408.91	0.23
XS2001315766 EURO WO 1.375 05-26	(366)	220526	3,000,000.	M EUR	102.7015	% 30/06/23	90.5195	4	3,081,045.21	2,720,431.31	4,846.31	-360,613.90	0.63
FR0013369493 EUTELT 2.0 10-25	(366)	021025	900,000.	M EUR	108.3277	% 30/06/23	90.7585	4	974,949.04	830,388.14	13,561.64	-144,560.90	0.19
FI4000507132 FINNAIR 4.25 05-25	(EUR)	190525	3,000,000.	M EUR	99.716	% 30/06/23	93.6405	4	2,991,480.00	2,825,152.50	15,937.50	-166,327.50	0.65
XS1987729412 FNAC DA 1.875 05-24	(EUR)	300524	3,200,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	97.58	4	3,200,000.00	3,128,226.67	5,666.67	-71,773.33	0.72
PTGGDDM0008 GALP GA 4.875 07-28	(366)	030728	3,500,000.	M EUR	99.8	% 30/06/23	100.024	E	3,493,000.00	3,501,306.19	466.19	8,306.19	0.81
XS2247623643 GETLINK 3.5 10-25	(USA)	301025	1,100,000.	M EUR	103.1954	% 30/06/23	97.9325	4	1,135,148.91	1,077,685.28	427.78	-57,463.63	0.25
XS2630524986 GREN FI 6.75 01-26	(366)	070126	3,700,000.	M EUR	99.75	% 30/06/23	99.8075	4	3,690,750.00	3,716,141.88	23,264.38	25,391.88	0.86
DE000HCB0BS6 HAMB CO 4.875 03-25	(366)	170325	3,400,000.	M EUR	99.948	% 30/06/23	99.6375	4	3,398,232.00	3,437,037.70	49,362.70	38,805.70	0.79
XS2075185228 HARL DA 0.9 11-24	(366)	191124	5,000,000.	M EUR	102.7267	% 30/06/23	95.3155	4	5,136,335.62	4,793,761.30	27,986.30	-342,574.32	1.11
XS2607183980 HARL DA 5.125 04-26	(366)	050426	1,800,000.	M EUR	99.702	% 30/06/23	100.952	4	1,794,636.00	1,839,820.43	22,684.43	45,184.43	0.42
XS2608828641 HOLD D 4.5 04-27	(366)	060427	2,400,000.	M EUR	99.603	% 30/06/23	98.6395	4	2,390,472.00	2,393,610.30	26,262.30	3,138.30	0.55
XS2486589596 HSBC 3.019 06-27	(366)	150627	5,000,000.	M EUR	98.7524	% 30/06/23	95.341	4	4,937,619.18	4,774,886.20	7,836.20	-162,732.98	1.10
XS1797138960 IBER IN 2.625 PERP	(366)	311299	3,000,000.	M EUR	106.6832	% 30/06/23	98.641	4	3,200,496.58	2,980,746.39	21,516.39	-219,750.19	0.69
XS2583741934 IBM INT 3.375 02-27	(366)	060227	3,750,000.	M EUR	99.772	% 30/06/23	98.546	4	3,741,450.00	3,746,793.49	51,318.49	5,343.49	0.87

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1654 R-CO CONVICTION CREDIT SD 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 VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET		DEV COT	P.R.U EN DEVISE		DATE COTA	COURS VALEUR	I F	Devise du portefeuille			PRCT	
			EXPR.	QUANTITE		ET EXPR.	COURS				<-----> PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL	ACT NET
FR0013287273	ILIAD 1.5 10-24	(366) 141024	1,500,000.		M EUR	98.9841	%	30/06/23	96.388	4	1,484,761.48	1,462,032.33	16,212.33	-22,729.15	0.34
XS2291929573	INEO QU 2.5 01-26	(EUR) 150126	2,100,000.		M EUR	100.	%	30/06/23	89.817	4	2,100,000.00	1,910,802.83	24,645.83	-189,197.17	0.44
XS2413696761	ING GRO 0.125 11-25	(366) 291125	4,000,000.		M EUR	93.9086	%	30/06/23	93.915	4	3,756,342.47	3,759,572.60	2,972.60	3,230.13	0.87
FR0013367174	IPSOS 2.875 09-25	(366) 210925	2,500,000.		M EUR	108.8278	%	30/06/23	96.0595	E	2,720,695.82	2,457,805.99	56,318.49	-262,889.83	0.57
FR0013509627	JCDE 2.0 10-24	(366) 241024	3,000,000.		M EUR	106.8153	%	30/06/23	97.2795	4	3,204,458.90	2,959,974.04	41,589.04	-244,484.86	0.68
FR0014000774	LA MOND 0.75 04-26	(366) 200426	4,500,000.		M EUR	96.1453	%	30/06/23	90.7585	4	4,326,540.41	4,091,048.48	6,915.98	-235,491.93	0.94
XS2563348361	LEASYS 4.375 12-24	(366) 071224	3,500,000.		M EUR	99.863	%	30/06/23	99.67	4	3,495,205.00	3,576,129.79	87,679.79	80,924.79	0.83
XS2148623106	LLOY BA 3.5 04-26	(366) 010426	3,900,000.		M EUR	99.3601	%	30/06/23	97.8825	4	3,875,042.84	3,852,474.88	35,057.38	-22,567.96	0.89
XS2027364244	LOGI FI 0.75 07-24	(366) 150724	3,579,000.		M EUR	102.4154	%	30/06/23	95.326	4	3,665,445.69	3,437,751.09	26,033.55	-227,694.60	0.79
XS1989375503	MORG ST 0.637 07-24	(366) 260724	5,000,000.		M EUR	99.3309	%	30/06/23	99.816	4	4,966,546.30	5,020,730.27	29,930.27	54,183.97	1.16
XS2197673747	MTU AER 3.0 07-25	(366) 010725	2,553,000.		M EUR	103.2955	%	30/06/23	99.087	4	2,637,133.19	2,530,318.90	627.79	-106,814.29	0.58
FR0014003Y09	MUTU AS 0.625 06-27	(366) 210627	4,000,000.		M EUR	86.9318	%	30/06/23	85.524	4	3,477,270.42	3,421,847.98	887.98	-55,422.44	0.79
XS2595410775	NEST FI 3.5 12-27	(366) 131227	4,600,000.		M EUR	99.543	%	30/06/23	100.478	E	4,578,978.00	4,671,831.84	49,843.84	92,853.84	1.08
XS1722898431	NEW EUR 1.75 11-24	(366) 231124	2,500,000.		M EUR	98.7918	%	30/06/23	95.035	4	2,469,794.52	2,402,604.45	26,729.45	-67,190.07	0.55
XS1978668298	NIBC BA 2.0 04-24	(366) 090424	1,100,000.		M EUR	99.939	%	30/06/23	97.7675	4	1,099,329.00	1,080,611.90	5,169.40	-18,717.10	0.25
XS2430442868	NOVA KR 1.875 01-25	(366) 270125	3,600,000.		M EUR	99.92	%	30/06/23	96.8045	E	3,597,120.00	3,514,181.18	29,219.18	-82,938.82	0.81
XS2498964209	NOVA LJ 6.0 07-25	(366) 190725	3,100,000.		M EUR	100.	%	30/06/23	99.9215	4	3,100,000.00	3,275,922.66	178,356.16	175,922.66	0.76
XS2241400295	OCI NV 3.625 10-25	(EUR) 151025	3,600,000.		M EUR	99.4034	%	30/06/23	97.266	4	3,220,671.25	3,177,192.15	25,773.75	-43,479.10	0.73
FR0013414919	ORANO 3.375 04-26	(366) 230426	1,600,000.		M EUR	98.6495	%	30/06/23	97.4695	4	1,578,392.13	1,570,134.95	10,622.95	-8,257.18	0.36
FR001400DA04	ORANO 5.375 05-27	(366) 150527	3,300,000.		M EUR	106.0589	%	30/06/23	102.441	4	3,499,943.84	3,404,784.56	24,231.56	-95,159.28	0.79
FR0013322187	ORPEA 2.625 03-25	(366) 100325	3,800,000.		M EUR	102.6119	%	30/06/23	30.33	4	3,899,252.88	1,184,154.75	31,614.75	-2,715,098.13	0.27
XS2582358789	PKO BAN 5.625 02-26	(366) 010226	3,250,000.		M EUR	99.9217	%	30/06/23	100.2315	4	3,247,456.00	3,334,154.74	76,630.99	86,698.74	0.77
XS2484339499	PPG IND 1.875 06-25	(366) 010625	1,500,000.		M EUR	99.741	%	30/06/23	95.9405	4	1,496,115.00	1,441,643.36	2,535.86	-54,471.64	0.33
XS2015267953	PSA BAN 0.625 06-24	(366) 210624	3,000,000.		M EUR	102.2781	%	30/06/23	96.6275	4	3,068,343.29	2,899,490.98	665.98	-168,852.31	0.67
XS2115189875	QPAR HO 1.5 03-25	(EUR) 010325	3,000,000.		M EUR	96.3436	%	30/06/23	96.104	4	2,890,308.33	2,898,495.00	15,375.00	8,186.67	0.67
FR0013478849	QUAD 2.25 02-25	(366) 030225	1,400,000.		M EUR	95.111	%	30/06/23	95.0395	4	1,331,553.42	1,343,584.51	13,031.51	12,031.09	0.31
XS2526835694	RAIF BA 4.125 09-25	(366) 080925	1,500,000.		M EUR	99.815	%	30/06/23	98.645	4	1,497,225.00	1,530,361.64	50,686.64	33,136.64	0.35
XS2559379529	RAIF BA 8.75 11-25	(366) 241125	1,200,000.		M EUR	100.	%	30/06/23	103.226	4	1,200,000.00	1,303,150.36	64,438.36	103,150.36	0.30
XS2236283383	SCAN CV 0.5 10-23	(366) 061023	1,000,000.		M EUR	99.798	%	30/06/23	99.1005	4	997,980.00	994,717.33	3,712.33	-3,262.67	0.23
FR0013259116	SEB 1.5 05-24	(366) 310524	1,600,000.		M EUR	103.5586	%	30/06/23	97.7215	4	1,656,937.42	1,565,773.51	2,229.51	-91,163.91	0.36
XS2607381436	SECU TR 4.25 04-27	(366) 040427	2,350,000.		M EUR	99.917	%	30/06/23	99.625	4	2,348,049.50	2,366,019.81	24,832.31	17,970.31	0.55
FR0013479276	SG 0.75 01-27	(366) 250127	3,000,000.		M EUR	88.4118	%	30/06/23	87.6405	4	2,652,353.42	2,639,078.01	9,863.01	-13,275.41	0.61
DE000A351WB9	SIXT SE 5.125 10-27	(366) 091027	3,000,000.		M EUR	100.129	%	30/06/23	102.66	4	3,003,870.00	3,090,330.82	10,530.82	86,460.82	0.71
XS1849518276	SMUR KA 2.875 01-26	(EUR) 150126	3,000,000.		M EUR	111.2219	%	30/06/23	96.61	4	3,336,656.25	2,938,789.58	40,489.58	-397,866.67	0.68
XS2178832379	STELLANTIS NV 3.375	(366) 070723	3,600,000.		M EUR	100.	%	30/06/23	100.034	4	3,600,000.00	3,721,725.37	120,501.37	121,725.37	0.86
XS2538445581	SYDB AS 4.75 09-25	(366) 300925	3,500,000.		M EUR	99.843	%	30/06/23	99.2545	4	3,494,505.00	3,600,075.31	126,167.81	105,570.31	0.83
FR0013144201	TDF INFR 2.5 04-26	(366) 070426	4,500,000.		M EUR	95.4103	%	30/06/23	93.9405	4	4,293,461.47	4,254,371.68	27,049.18	-39,089.79	0.98
FR0011593300	TECH LI 3.15 10-23	(366) 181023	4,000,000.		M EUR	105.2826	%	30/06/23	99.38	E	4,211,305.21	4,064,608.22	89,408.22	-146,696.99	0.94
FR0012881555	TEREGA 2.2% 05-08-25	(366) 050825	3,000,000.		M EUR	98.3809	%	30/06/23	96.5915	4	2,951,427.12	2,957,958.70	60,213.70	6,531.58	0.68
FR0013298890	TIKE CA 3.0 11-23	(366) 271123	2,200,000.		M EUR	106.8675	%	30/06/23	99.6465	4	2,351,084.93	2,231,823.00	39,600.00	-119,261.93	0.52
XS2293733825	TRAF FU 3.875 02-26	(366) 020226	4,000,000.		M EUR	100.	%	30/06/23	94.3235	4	4,000,000.00	3,837,487.95	64,547.95	-162,512.05	0.89
DE000A3LHK72	TRAT FI 4.0 09-25	(366) 160925	2,800,000.		M EUR	99.71	%	30/06/23	98.873	E	2,791,880.00	2,783,479.62	15,035.62	-8,400.38	0.64
XS1958656552	UBI BAN 5.875 03-29	(366) 040329	800,000.		M EUR	114.1291	%	30/06/23	100.4405	4	913,032.88	819,190.67	15,666.67	-93,842.21	0.19
FR0013330529	UNIB RO 2.125 PERP	(366) 311299	5,100,000.		M EUR	95.6586	%	30/06/23	85.6255	4	4,878,586.36	4,441,723.79	74,823.29	-436,862.57	1.03
XS2017471553	UNIC 1.25 06-25	(366) 250625	1,000,000.		M EUR	98.0832	%	30/06/23	96.837	4	980,831.51	968,677.38	307.38	-12,154.13	0.22
XS2207976783	UNIC 2.2 07-27	(366) 220727	1,000,000.		M EUR	94.8392	%	30/06/23	92.4565	4	948,391.78	945,480.07	20,915.07	-2,911.71	0.22
ES0280907017	UNIC BA 2.875 11-29	(366) 131129	2,000,000.		M EUR	101.7741	%	30/06/23	90.72	4	2,035,482.19	1,851,105.48	36,705.48	-184,376.71	0.43
XS2389688107	VITE FI 0.375 09-25	(366) 240925	3,000,000.		M EUR	99.774	%	30/06/23	91.3015	4	2,993,220.00	2,747,767.60	8,722.60	-245,452.40	0.63

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1654 R-CO CONVICTION CREDIT SD 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 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	
AT000B122080 VOLK WI 0.875 03-26		(366) 230326	5,000,000.	M EUR	99.456	% 30/06/23	88.168	4	4,972,800.00	4,420,712.16	12,312.16	-552,087.84	1.02
XS2583352443 VOLV TR 3.5 11-25		(366) 171125	1,400,000.	M EUR	99.949	% 30/06/23	98.841	4	1,399,286.00	1,402,165.78	18,391.78	2,879.78	0.32
DE000A30VQA4 VONO SE 4.75 05-27		(366) 230527	3,000,000.	M EUR	100.0451	% 30/06/23	98.2065	4	3,001,353.00	2,962,547.46	16,352.46	-38,805.54	0.68
XS2167007249 WELL FA 1.338 05-25		(366) 040525	5,000,000.	M EUR	97.9854	% 30/06/23	97.2195	4	4,899,269.32	4,872,125.00	11,150.00	-27,144.32	1.13
XS2392462730 WERF 0.5 10-26		(366) 281026	1,400,000.	M EUR	99.45	% 30/06/23	87.697	4	1,392,300.00	1,232,533.34	4,775.34	-159,766.66	0.28
XS2054209320 WINT DE 0.452 09-23		(366) 250923	5,000,000.	M EUR	100.2277	% 30/06/23	99.127	4	5,011,383.30	4,973,810.82	17,460.82	-37,572.48	1.15
XS2054209833 WINT DE 0.84 09-25		(366) 250925	6,400,000.	M EUR	101.4811	% 30/06/23	92.1535	4	6,494,790.91	5,939,359.12	41,535.12	-555,431.79	1.37
XS2433361719 WIZZ AI 1.0 01-26		(366) 190126	1,900,000.	M EUR	99.762	% 30/06/23	88.417	4	1,895,478.00	1,688,564.10	8,641.10	-206,913.90	0.39
XS2288097483 WIZZ AI 1.35 01-24		(366) 190124	2,000,000.	M EUR	97.427	% 30/06/23	97.9425	4	1,948,539.73	1,971,129.45	12,279.45	22,589.72	0.46
XS2010039381 ZF EURO 2.0 02-26		(366) 230226	4,500,000.	M EUR	99.991	% 30/06/23	91.227	4	4,499,594.26	4,137,516.37	32,301.37	-362,077.89	0.96

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CUMUL (EUR)

400,511,893.33 384,979,722.44 4,632,728.67 -15,532,170.89 88.92

DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING

FR0014003YZ5 CLAR 4.125 PERP

(366) 311299 2,500,000.

M GBP

99.655 % 30/06/23

80.789

4

2,893,583.04

2,359,461.34

6,237.45

-534,121.70

0.54

Obligations à taux variable, révisable négo. sur u

DEVISE VALEUR : EUR EURO

XS1978210273 ABEN AB 1.5 10-24

(EUR) 261024 353,197.

P EUR

0. M 30/06/23

0.

E

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

XS1291167226 GOLD SACH FLR 10-25

(EUR) 221025 1,600,000.

M EUR

98.8618 % 30/06/23

97.92

4

1,581,788.80

1,578,278.40

11,558.40

-3,510.40

0.36

XS2597970800 INTE FLR 03-25

(999) 170325 1,000,000.

M EUR

100.9008 % 30/06/23

100.0435

4

1,009,008.19

1,002,175.42

1,740.42

-6,832.77

0.23

IT0005279887 INTE FLR 09-24

(UST) 260924 3,000,000.

M EUR

102.0761 % 30/06/23

100.1165

E

3,062,282.70

3,007,068.91

3,573.91

-55,213.79

0.69

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CUMUL (EUR)

5,653,079.69 5,587,522.73 16,872.73 -65,556.96 1.29

Obligations convertibles négo. sur un marché regl.

DEVISE VALEUR : EUR EURO

XS1978209002 ABEN AB 1.5 10-24

(EUR) 261024 353,197.

P EUR

0. M 30/06/23

0.

E

0.00

0.00

0.00

0.00

0.00

Obligations & valeurs assimilées négociés sur un marché réglementé

CUMUL (EUR)

409,058,556.06 392,926,706.51 4,655,838.85 -16,131,849.55 90.76

II - Titres de creances

TCN negociés sur marche regl.ou ass

Bons du tresor

DEVISE VALEUR : EUR EURO

MATURITE : moins de 2 ans

FR0127613505 FRANCE 210224

NOL (999) 210224 20,000,000.

EUR

97.495 30/06/23

3.62

4

19,499,000.00

19,538,299.14

0.00

39,299.14

4.51

III - Titres d'OPCVM

## Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1654 R-CO CONVICTION CREDIT SD 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	
<b>OPCVM européens coordonnés et assimilables</b>													
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
FRO007442496	RMM COURT TERME C	6,370.	P EUR	3963.3722	M 29/06/23	3970.52	5	25,246,680.64	25,292,212.40	0.00	45,531.76	5.84	
<b>VIII - TRESORERIE</b>													
<b>Dettes et créances</b>													
<b>Règlements différés</b>													
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
ARDEUR	Ach rgl t différé	-6,868,218.44	EUR	1.	30/06/23	1.		-6,868,218.44	-6,868,218.44	0.00	0.00	-1.59	
RACHEUR	Rachats a payer	-27,861.49	EUR	1.	30/06/23	1.		-27,861.49	-27,861.49	0.00	0.00	-0.01	
SOUSEUR	Souscriptions/payer	10,254.51	EUR	1.	30/06/23	1.		10,254.51	10,254.51	0.00	0.00	0.00	
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
								CUMUL (EUR)	-6,885,825.42	-6,885,825.42	0.00	0.00	-1.59
<b>Coupons et dividendes en espèces</b>													
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
ES0213211131	BBVA 6.2 07-23	22.	P EUR	3100.	30/06/23			68,200.00	68,200.00	0.00	0.00	0.02	
IT0005199267	UNIC SPA FLR 06-23	1,000.	P EUR	9.2875	30/06/23			9,287.50	9,287.50	0.00	0.00	0.00	
XS2197673747	MTU AER 3.0 07-25	2,553.	P EUR	30.	30/06/23			76,590.00	76,590.00	0.00	0.00	0.02	
XS2247623643	GETLINK 3.5 10-25	1,100.	P EUR	17.5	30/06/23			19,250.00	19,250.00	0.00	0.00	0.00	
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
								CUMUL (EUR)	173,327.50	173,327.50	0.00	0.00	0.04
<b>Frais de gestion</b>													
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
FGPVFC1EUR	Frais de Gest. Fixe	-61,154.35	EUR	1.	30/06/23	1.		-61,154.35	-61,154.35	0.00	0.00	-0.01	
FGPVFC2EUR	Frais de Gest. Fixe	-45,528.05	EUR	1.	30/06/23	1.		-45,528.05	-45,528.05	0.00	0.00	-0.01	
FGPVFD1EUR	Frais de Gest. Fixe	-53,081.66	EUR	1.	30/06/23	1.		-53,081.66	-53,081.66	0.00	0.00	-0.01	
FGPVFD3EUR	Frais de Gest. Fixe	-2,054.08	EUR	1.	30/06/23	1.		-2,054.08	-2,054.08	0.00	0.00	0.00	
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
								CUMUL (EUR)	-161,818.14	-161,818.14	0.00	0.00	-0.04
<b>Dettes et créances</b>													
								CUMUL (EUR)	-6,874,316.06	-6,874,316.06	0.00	0.00	-1.59
<b>Disponibilités</b>													
<b>Avoirs en france</b>													
<b>DEVISE VALEUR : AUD DOLLAR AUSTRALIEN</b>													
BORCAUD	ROTHSCHILD MM	0.23	AUD	0.7826087	30/06/23	0.60983047		0.18	0.14	0.00	-0.04	0.00	
<b>DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE</b>													
BORCCHF	ROTHSCHILD MM	0.56	CHF	0.80357143	30/06/23	1.02165917		0.45	0.57	0.00	0.12	0.00	
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
BORCEUR	ROTHSCHILD MM	1,562.25	EUR	1.	30/06/23	1.		1,562.25	1,562.25	0.00	0.00	0.00	
<b>DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING</b>													

## Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1654 R-CO CONVICTION CREDIT SD 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 VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET		DEV COT	P. R. U EN DEVISE		DATE COTA	COURS VALEUR	I F	Devise du portefeuille				PRCT		
			EXPR.	QUANTITE		ET EXPR.	COURS				<----- PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL	ACT	NET	
BQRCGBP	ROTHSCHILD MM		206,250.27		GBP	1.16838931		30/06/23	1.16512094		240,980.61	240,306.51	0.00	-674.10	0.06		
<b>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</b>																	
BQRCUSD	ROTHSCHILD MM		1,970,589.43		USD	0.94356094		30/06/23	0.92030186		1,859,371.21	1,813,537.12	0.00	-45,834.09	0.42		
<b>Avoirs en france</b>																	
											CUMUL (EUR)	2,101,914.70	2,055,406.59	0.00	-46,508.11	0.47	
<b>Opérations à terme</b>																	
<b>DATE ECHEANCE : 15/09/23</b>																	
23164003596	V GBP EUR	15/09/23	2,890,626.18		EUR	1.		30/06/23	1.		2,890,626.18	2,890,626.18	0.00	0.00	0.67		
		15/09/23	-2,491,000.		GBP	1.1604		30/06/23	1.16153242		-2,890,626.18	-2,893,377.27	0.00	-2,751.09	-0.67		
<b>SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 15/09/23</b>																	
											CUMUL (EUR)	0.00	-2,751.09	0.00	-2,751.09		
<b>Disponibilités</b>																	
											CUMUL (EUR)	2,101,914.70	2,052,655.50	0.00	-49,259.20	0.47	
<b>VIII - TRESORERIE</b>																	
											CUMUL (EUR)	-4,772,401.36	-4,821,660.56	0.00	-49,259.20	-1.11	
<b>PORTEFEUILLE : R-CO CONVICTION CREDIT SD EURO (1654 )</b>																	
											(EUR)	449,236,528.76	432,935,557.49	4,655,838.85	-16,300,971.27	100.00	

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

PORTEFEUILLE : 1654 R-CO CONVICTION CREDIT SD EURO

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)

Portefeuille titres : 437,754,466.96 Coupons et dividendes a recevoir : 173,327.5

Frais de gestion du jour

Frais de Gest. Fixe :	2,038.63	EUR
Frais de Gest. Fixe :	1,812.8	EUR
Frais de Gest. Fixe :	68.46	EUR
Frais de Gest. Fixe :	1,564.24	EUR

Frais de gestion charge Entreprise

FRAIS MAXIMUM :	2,038.63	EUR
FRAIS MAXIMUM :	1,564.24	EUR
FRAIS MAXIMUM :	1,812.8	EUR
Frais maximum notice :	68.46	EUR

Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
C1 FR0014006PM4 R-CO CC SD-CEURA	EUR	124,014,634.67	794,875.58834	156.02	28.645164439555			159.14	152.90
C2 FR0011208073 R-CO CONVICT CRED SD	EUR	190,314,262.47	1,769.1853	107,571.70	43.958832361928			109,723.13	105,420.27
D1 FR0014006PL6 R-CO CONVICT CRE SD D	EUR	110,276,972.90	1,076,504.60315	102.44	25.472010066764			104.49	100.39
D3 FR001400DDK6 RCO CONV CRED ID	EUR	8,329,687.45	81.4918	102,215.04	1.923993131753			104,259.34	102,215.04
C4 FR0013111770 R-CO CONV CRED SD I	EUR	0.00	0.	1.00	0.			0.00	0.00
D2 FR0012243970 R-CO CONV CRED SD M	EUR	0.00	0.	1,000.00	0.			0.00	0.00

Actif net total en EUR : 432,935,557.49

Precedente VL en date du 29/06/23 :

C1	R-CO CC SD-CEURA	Prec. VL :	155.96	(EUR)	Variation :	+0.038%
C2	R-CO CONVICT CRED SD	Prec. VL :	107,528.41	(EUR)	Variation :	+0.040%
D1	R-CO CONVICT CRE SD D	Prec. VL :	102.4	(EUR)	Variation :	+0.039%
D3	RCO CONV CRED ID EUR	Prec. VL :	102,173.91	(EUR)	Variation :	+0.040%

VL theorique

Part	Devise	Actif theorique	Valeur liquidative theorique
C1 FR0014006PM4 R-CO CC SD-CEURA	EUR	124,014,634.67	156.02
C2 FR0011208073 R-CO CONVICT CRED SD	EUR	190,314,262.47	107,571.70
D1 FR0014006PL6 R-CO CONVICT CRE SD D	EUR	110,276,972.90	102.44
D3 FR001400DDK6 RCO CONV CRED ID EUR	EUR	8,329,687.45	102,215.04

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1654 R-CO CONVICTION CREDIT SD EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

Actif theorique total en EUR : 432,935,557.49 ( Sens collecte : EQU )

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

Type reporting : TIBR Revenu taxable pour résidents Belges

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

Poids DD : 95.48 Statut DD : 0

Poids DI : 99.37 Statut DI : M

Type reporting : TISF TIS France

Poids officiels et statuts en date du 30/06/23 :

Poids DD : 94.4 Statut DD : I

Poids DI : 100. Statut DI : M

Poids non officiels en date du 30/06/23 :

Poids DD : 94.4

Poids DI : 100.

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1654 R-CO CONVICTION CREDIT SD 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 AUD :	1.6398	cotation :	30/06/23	0.	1.648	cotation :	29/06/23	-0.49757
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 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 INVERSEES DES DEVICES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente		
Cours AUD en EUR :	0.6098304671	cotation :	30/06/23	0.	0.6067961165	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 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

# **R-CO CONVICTION CREDIT SD 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	412 465 005,65
b) Avoirs bancaires	2 055 406,59
c) Autres actifs détenus par l'OPC	28 366 420,59
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	442 886 832,83
e) Passif	-9 951 275,34
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	432 935 557,49

\* 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 CREDIT SD EURO C EUR en EUR	C	124 014 634,67	794 875,588340	156,02
R-CO CONVICTION CREDIT SD EURO D EUR en EUR	D	110 276 972,90	1 076 504,603150	102,44
R-CO CONVICTION CREDIT SD EURO ID EUR en EUR	D	8 329 687,45	81,4918	102 215,04
R-CO CONVICTION CREDIT SD EURO I EUR en EUR	C	190 314 262,47	1 769,1853	107 571,70

## 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.	81,70	79,86
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.	13,57	13,27
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.	5,84	5,71

\* 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 DEVISE

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Euro	EUR	410 105 544,31	94,73	92,60
Livre Sterling	GBP	2 359 461,34	0,54	0,53
TOTAL		412 465 005,65	95,27	93,13

\* 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	26,50	25,90
PAYS-BAS	12,86	12,57
ETATS-UNIS	8,62	8,43
ALLEMAGNE	8,19	8,00
LUXEMBOURG	6,27	6,13
ITALIE	5,81	5,67
ESPAGNE	4,75	4,64
ROYAUME-UNI	4,28	4,18
IRLANDE	3,98	3,89
BELGIQUE	3,19	3,11
PORTUGAL	1,80	1,76
DANEMARK	1,71	1,68
SLOVENIE	1,57	1,53
SUEDE	1,44	1,40
AUTRICHE	1,37	1,34
POLOGNE	0,77	0,75
CANADA	0,67	0,66
FINLANDE	0,65	0,64
REPUBLIQUE TCHEQUE	0,56	0,54
HONGRIE	0,30	0,29
TOTAL	95,27	93,13

\* 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 **
<b>Organismes de placement collectif</b>		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	5,84	5,71
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
<b>Autres actifs</b>		
Autres	0,00	0,00
<b>TOTAL</b>	<b>5,84</b>	<b>5,71</b>

\* 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.	157 183 501,76	76 292 142,54
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.	29 445 841,44	15 835 965,77
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.	80 125 893,57	75 269 007,52

## DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Action	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
<b>Dividendes versés</b>				
26/05/2023	R-CO CONVICTION CREDIT SD EURO ID EUR	220,73	0,00	220,73
26/05/2023	R-CO CONVICTION CREDIT SD EURO D EUR	1,33	0,00	1,33
<b>Dividendes à verser</b>				
	R-CO CONVICTION CREDIT SD EURO D EUR			
	R-CO CONVICTION CREDIT SD EURO ID EUR			

**PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2023 EN EUR**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Actions et valeurs assimilées</b>				
<b>Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ESPAGNE</b>				
ABENGOA CL B	EUR	947 069	0,00	0,00
ABENGOA SA	EUR	91 590	0,00	0,00
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>ETATS-UNIS</b>				
FNMA 8.25% ACTION PREF.	USD	40 000	0,00	0,00
<b>TOTAL ETATS-UNIS</b>			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>JERSEY</b>				
HYPO ALPE 7.375% PREFERED - PERPETUAL	EUR	3 100	0,00	0,00
<b>TOTAL JERSEY</b>			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>TOTAL Actions et valeurs assimilées</b>			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Obligations et valeurs assimilées</b>				
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
ACCENTRO REAL ESTATE AG 3.625% 13-02-26	EUR	2 500 000	1 413 898,94	0,32
ALLIANZ SE 4.75% PERP EMTN	EUR	4 000 000	4 125 838,63	0,95
CECONOMY AG 1.75% 24-06-26	EUR	6 400 000	5 030 356,11	1,16
CMZB 0 1/2 09/13/23	EUR	2 300 000	2 295 118,01	0,53
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 1.625% 16-11-23	EUR	2 200 000	2 200 296,40	0,51
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2.0% 14-07-24	EUR	3 900 000	3 884 993,01	0,90
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 4.375% 28-08-26	EUR	4 400 000	4 476 989,75	1,04
HAMBURG COMMERCIAL BANK AG 4.875% 17-03-25	EUR	3 400 000	3 437 037,70	0,80
MTU AERO ENGINES 3.0% 01-07-25	EUR	2 553 000	2 530 318,90	0,58
SIXT SE 5.125% 09-10-27 EMTN	EUR	3 000 000	3 090 330,82	0,71
VONOVIA SE 4.75% 23-05-27 EMTN	EUR	3 000 000	2 962 547,46	0,69
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>35 447 725,73</b>	<b>8,19</b>
<b>AUTRICHE</b>				
RAIFFEISEN BANK INTL AG 4.125% 08-09-25	EUR	1 500 000	1 530 361,64	0,35
VOLKSBANK WIEN AG SVP 0.875% 23-03-26	EUR	5 000 000	4 420 712,16	1,02
<b>TOTAL AUTRICHE</b>			<b>5 951 073,80</b>	<b>1,37</b>
<b>BELGIQUE</b>				
ARGENTA SPAARBANK 5.375% 29-11-27	EUR	4 000 000	4 113 041,92	0,95
CRELAN 5.375% 31-10-25 EMTN	EUR	4 200 000	4 333 039,32	1,00
ETHIAS VIE 5.0% 14-01-26	EUR	5 200 000	5 348 432,22	1,24
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>13 794 513,46</b>	<b>3,19</b>
<b>CANADA</b>				
BANK OF NOVA SCOTIA TORONTO 0.5% 30-04-24	EUR	3 000 000	2 916 953,93	0,67
<b>TOTAL CANADA</b>			<b>2 916 953,93</b>	<b>0,67</b>
<b>DANEMARK</b>				
DANSKE BK 0.5% 27-08-25	EUR	4 000 000	3 819 801,10	0,88
SYDBANK AS 4.75% 30-09-25 EMTN	EUR	3 500 000	3 600 075,31	0,83
<b>TOTAL DANEMARK</b>			<b>7 419 876,41</b>	<b>1,71</b>
<b>ESPAGNE</b>				

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ABANCA CORPORACION BANCARIA 5.5% 18-05-26	EUR	2 700 000	2 704 030,67	0,63
ABENGOA ABENEWCO 2 SAU 1.5% 26-10-24	EUR	353 197	0,00	0,00
ABENGOA ABENEWCO 2 SAU 1.5% 26-10-24 DEFAULT	EUR	353 197	0,00	0,00
BANCO DE BADELL 0.875% 22-07-25	EUR	5 000 000	4 681 692,47	1,08
BBVA 4.125% 10-05-26	EUR	5 900 000	5 887 396,25	1,36
BBVA 6.2% 04-07-23 EMTN	EUR	1 100 000	1 100 000,00	0,25
CELLNEX FINANCE 2.25% 12-04-26	EUR	3 300 000	3 114 845,11	0,72
UNICAJA BAN 2.875% 13-11-29	EUR	2 000 000	1 851 105,48	0,43
WERFENLIFE 0.5% 28-10-26	EUR	1 400 000	1 232 533,34	0,28
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>20 571 603,32</b>	<b>4,75</b>
<b>ETATS-UNIS</b>				
BAC 2 3/8 06/19/24	EUR	3 000 000	2 955 415,08	0,68
CELANESE US HOLDINGS LLC 4.777% 19-07-26	EUR	3 450 000	3 528 580,13	0,82
CELA US HOLD 1.125% 26-09-23	EUR	1 199 000	1 200 943,53	0,27
CORNING 3.875% 15-05-26	EUR	3 650 000	3 629 007,81	0,84
EURONET WORLDWIDE 1.375% 22-05-26	EUR	3 000 000	2 720 431,31	0,63
GOLD SACH GR E6R+0.0% 22-10-25	EUR	1 600 000	1 578 278,40	0,36
HARLEY DAVIDSON FINANCIAL SERVICE 0.9% 19-11-24	EUR	5 000 000	4 793 761,30	1,11
HARLEY DAVIDSON FINANCIAL SERVICE 5.125% 05-04-26	EUR	1 800 000	1 839 820,43	0,42
IBM INTL BUSINESS MACHINES 3.375% 06-02-27	EUR	3 750 000	3 746 793,49	0,87
MORGAN STANLEY CAPITAL SERVICE 0.637% 26-07-24	EUR	5 000 000	5 020 730,27	1,16
PPG INDUSTRIES 1.875% 01-06-25	EUR	1 500 000	1 441 643,36	0,33
WELLS FARGO AND 1.338% 04-05-25	EUR	5 000 000	4 872 125,00	1,13
<b>TOTAL ETATS-UNIS</b>			<b>37 327 530,11</b>	<b>8,62</b>
<b>FINLANDE</b>				
FINNAIR 4.25% 19-05-25	EUR	3 000 000	2 825 152,50	0,66
<b>TOTAL FINLANDE</b>			<b>2 825 152,50</b>	<b>0,66</b>
<b>FRANCE</b>				
ALD 0.375% 19-10-23 EMTN	EUR	2 100 000	2 084 293,44	0,48
ALD 1.25% 02-03-26 EMTN	EUR	2 500 000	2 322 474,93	0,54
ALD 4.75% 13-10-25 EMTN	EUR	1 600 000	1 669 329,86	0,38
ARVAL SERVICE LEASE 4.0% 22-09-26	EUR	6 300 000	6 424 978,62	1,48
BFCM 3.0% 11-09-25 EMTN	EUR	1 900 000	1 890 982,16	0,44
BFCM BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL 0.01% 11-05-26	EUR	2 000 000	1 778 759,51	0,41
BNP PAR 1.125% 22-11-23 EMTN	EUR	4 300 000	4 286 408,17	0,99
BNP PAR 2.125% 23-01-27 EMTN	EUR	1 500 000	1 420 742,26	0,33
BNP PAR CARDIF 1.0% 29-11-24	EUR	3 500 000	3 355 030,72	0,78
BPCE 3.0% 19-07-26 EMTN	EUR	2 000 000	1 934 187,47	0,45
BPCE 3.5% 28-10-27	EUR	1 100 000	1 076 875,04	0,25
BPCE 3.625% 17-04-26 EMTN	EUR	2 300 000	2 281 830,94	0,52
BPCE 4.625% 18/07/23	EUR	2 000 000	2 089 102,05	0,49
BQ POSTALE 1.0% 16-10-24 EMTN	EUR	1 000 000	967 255,68	0,22
BURE VERI 2.0% 07-09-26	EUR	1 700 000	1 600 181,71	0,37
CA 3.0% 21-12-25 EMTN	EUR	1 500 000	1 448 909,67	0,33
CLARIANE 4.125% PERP	GBP	2 500 000	2 359 461,34	0,54
COVIVIO SA 1.625% 17-10-24	EUR	400 000	391 104,14	0,09
CREDIT AGRICOLE SA 2.85% 27-04-26	EUR	4 000 000	3 847 916,70	0,89

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CRED MUT 3.25% 01-06-26 EMTN	EUR	1 700 000	1 639 939,56	0,38
EUTELT 2.0% 02-10-25	EUR	900 000	830 388,14	0,20
FNAC DARTY 1.875% 30-05-24	EUR	3 200 000	3 128 226,67	0,73
GETLINK 3.5% 30-10-25	EUR	1 100 000	1 077 685,28	0,25
HOLDING D INFRASTRUCTURES DES METIERS 4.5% 06-04-27	EUR	2 400 000	2 393 610,30	0,55
ILIAD 1.5% 14-10-24	EUR	1 500 000	1 462 032,33	0,34
IPSOS 2.875% 21-09-25	EUR	2 500 000	2 457 805,99	0,56
JCDECAUX 2.0% 24-10-24	EUR	3 000 000	2 959 974,04	0,68
LA MONDIALE 0.75% 20-04-26	EUR	4 500 000	4 091 048,48	0,95
MUTUELLE ASSUR DES COMMERC ET IND FR 0.625% 21-06-27	EUR	4 000 000	3 421 847,98	0,79
ORANO 3.375% 23-04-26 EMTN	EUR	1 600 000	1 570 134,95	0,36
ORANO 5.375% 15-05-27 EMTN	EUR	3 300 000	3 404 784,56	0,78
ORPEA 2.625% 10-03-25 EMTN	EUR	3 800 000	1 184 154,75	0,28
PSA BANQUE FRANCE 0.625% 21-06-24	EUR	3 000 000	2 899 490,98	0,67
QUADIENT 2.25% 03-02-25	EUR	1 400 000	1 343 584,51	0,31
SEB 1.5% 31-05-24	EUR	1 600 000	1 565 773,51	0,37
SG 0.75% 25-01-27	EUR	3 000 000	2 639 078,01	0,61
TDF INFR SAS 2.5% 07-04-26	EUR	4 500 000	4 254 371,68	0,98
TEREGA 2.2% 05-08-25	EUR	3 000 000	2 957 958,70	0,68
TIKEHAU CAPITAL 3.0% 27-11-23	EUR	2 200 000	2 231 823,00	0,51
UNIBAIL RODAMCO SE 2.125% PERP	EUR	5 100 000	4 441 723,79	1,03
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>95 185 261,62</b>	<b>21,99</b>
<b>HONGRIE</b>				
RAIFFEISEN BANK RT BUDAPEST 8.75% 22-11-25	EUR	1 200 000	1 303 150,36	0,30
<b>TOTAL HONGRIE</b>			<b>1 303 150,36</b>	<b>0,30</b>
<b>IRLANDE</b>				
BK IRELAND GROUP 1.875% 05-06-26	EUR	4 000 000	3 775 702,62	0,88
CA AUTO BANK SPA IRISH BRANCH 4.375% 08-06-26	EUR	4 400 000	4 414 708,86	1,02
GRENKE FINANCE 6.75% 07-01-26	EUR	3 700 000	3 716 141,88	0,85
SECURITAS TREASURY IRELAND DAC 4.25% 04-04-27	EUR	2 350 000	2 366 019,81	0,55
SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS 2.875% 15-01-26	EUR	3 000 000	2 938 789,58	0,68
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>17 211 362,75</b>	<b>3,98</b>
<b>ITALIE</b>				
ACEA 0.0000010% 28-09-25 EMTN	EUR	2 000 000	1 820 490,00	0,43
AUTOSTRADA PER L ITALILIA 1.75% 01-02-27	EUR	5 000 000	4 603 528,08	1,07
AZIMUT 1.625% 12-12-24	EUR	3 400 000	3 301 390,45	0,76
BANCA MEDIOLANUM 5.035% 22-01-27	EUR	2 100 000	2 170 266,14	0,50
CASSA CENTRALE RAIFFEISEN DELLALTO ADIG 5.885% 16-02-27	EUR	2 850 000	2 919 184,14	0,68
INTE E3R+0.63% 17-03-25 EMTN	EUR	1 000 000	1 002 175,42	0,24
INTE E3R-4+1.9% 26-09-24	EUR	3 000 000	3 007 068,91	0,69
LEASYS 4.375% 07-12-24	EUR	3 500 000	3 576 129,79	0,82
UBI BANCA UNIONE DI BANCHE ITALIANE 5.875% 04-03-29	EUR	800 000	819 190,67	0,18
UNICREDIT 1.25% 25-06-25 EMTN	EUR	1 000 000	968 677,38	0,22
UNICREDIT 2.2% 22-07-27 EMTN	EUR	1 000 000	945 480,07	0,21
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>25 133 581,05</b>	<b>5,80</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
ARCELLOR MITTAL 4.875% 26-09-26	EUR	4 350 000	4 605 044,08	1,06

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS 0.5% 12-09-23	EUR	2 750 000	2 731 825,51	0,63
CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE 0.0% 01-04-24	EUR	3 200 000	3 104 208,00	0,72
CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE 1.75% 12-09-25	EUR	1 000 000	968 278,84	0,22
EUROFINS SCIENTIFIC 2.125% 25-07-24	EUR	990 000	988 146,12	0,23
LOGICOR FINANCING SARL 0.75% 15-07-24	EUR	3 579 000	3 437 751,09	0,79
NESTLE FIN 3.5% 13-12-27 EMTN	EUR	4 600 000	4 671 831,84	1,07
TRAFIGURA FUNDING 3.875% 02-02-26	EUR	4 000 000	3 837 487,95	0,89
TRATON FINANCE LUXEMBOURG 4.0% 16-09-25	EUR	2 800 000	2 783 479,62	0,65
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>27 128 053,05</b>	<b>6,26</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
ABN AMRO BK 3.75% 20-04-25	EUR	3 400 000	3 397 499,05	0,78
CETIN FINANCE BV 3.125% 14-04-27	EUR	3 700 000	3 450 198,14	0,79
CONTI GUMMI FINANCE BV 2.125% 27-11-23	EUR	2 400 000	2 413 692,00	0,56
CTP BV	EUR	3 000 000	2 952 060,00	0,68
EDP FIN ZCP 12-11-23 EMTN	EUR	2 000 000	1 968 500,00	0,46
IBERDROLA INTL BV 2.625% PERP	EUR	3 000 000	2 980 746,39	0,69
ING GROEP NV 0.125% 29-11-25	EUR	4 000 000	3 759 572,60	0,87
NEW EUROPE PROPERTY COOPERATIF 1.75% 23-11-24	EUR	2 500 000	2 402 604,45	0,56
NIBC BANK NV 2.0% 09-04-24	EUR	1 100 000	1 080 611,90	0,24
OCI NV 3.625% 15-10-25	EUR	3 600 000	3 177 192,15	0,74
QPARK HOLDING I BV 1.5% 01-03-25	EUR	3 000 000	2 898 495,00	0,67
STELLANTIS NV 3.375% 07-07-23	EUR	3 600 000	3 721 725,37	0,86
VITERRA FINANCE BV 0.375% 24-09-25	EUR	3 000 000	2 747 767,60	0,64
WINTERSHALL DEA SCHWEIZ BV 0.452% 25-09-23	EUR	5 000 000	4 973 810,82	1,15
WINTERSHALL DEA SCHWEIZ BV 0.84% 25-09-25	EUR	6 400 000	5 939 359,12	1,37
WIZZ AIR FINANCE CO BV 1.0% 19-01-26	EUR	1 900 000	1 688 564,10	0,39
WIZZ AIR FINANCE CO BV 1.35% 19-01-24	EUR	2 000 000	1 971 129,45	0,45
ZF EUROPE FINANCE BV 2.0% 23-02-26	EUR	4 500 000	4 137 516,37	0,95
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>55 661 044,51</b>	<b>12,85</b>
<b>POLOGNE</b>				
PKO BANK POLSKI 5.625% 01-02-26	EUR	3 250 000	3 334 154,74	0,77
<b>TOTAL POLOGNE</b>			<b>3 334 154,74</b>	<b>0,77</b>
<b>PORTUGAL</b>				
BCP 8.5% 25-10-25 EMTN	EUR	1 800 000	1 968 740,88	0,45
CAIXA CENTRAL DE CREDITO AGRICOLA MUTUO 8.375% 04-07-27	EUR	2 300 000	2 303 680,00	0,54
GALP GAS NATURAL DISTRIBUICAO 4.875% 03-07-28	EUR	3 500 000	3 501 306,19	0,81
<b>TOTAL PORTUGAL</b>			<b>7 773 727,07</b>	<b>1,80</b>
<b>REPUBLIQUE TCHEQUE</b>				
CESKA SPORITELNA AS 5.943% 29-06-27	EUR	2 400 000	2 404 168,52	0,56
<b>TOTAL REPUBLIQUE TCHEQUE</b>			<b>2 404 168,52</b>	<b>0,56</b>
<b>ROYAUME-UNI</b>				
BATSLN 2.75% 03/25/25	EUR	4 000 000	3 922 855,19	0,91
HSBC 3.019% 15-06-27	EUR	5 000 000	4 774 886,20	1,10
INEOS QUATTRO FINANCE 2 2.5% 15-01-26	EUR	2 100 000	1 910 802,83	0,44
LLOYDS BANKING GROUP 3.5% 01-04-26	EUR	3 900 000	3 852 474,88	0,89
TECHNIPFMC LIMITED 3.15% 18-10-23	EUR	4 000 000	4 064 608,22	0,94
<b>TOTAL ROYAUME-UNI</b>			<b>18 525 627,32</b>	<b>4,28</b>

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>SLOVENIE</b>				
NOVA KREDITNA BANKA MARIBOR DD 1.875% 27-01-25	EUR	3 600 000	3 514 181,18	0,81
NOVA LJUBLJANSKA BANKA DD 6.0% 19-07-25	EUR	3 100 000	3 275 922,66	0,76
<b>TOTAL SLOVENIE</b>			<b>6 790 103,84</b>	<b>1,57</b>
<b>SUEDE</b>				
AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY 1.75% 07-02-25	EUR	2 083 000	1 963 212,80	0,45
ELECTROLUX AB 4.125% 05-10-26	EUR	1 800 000	1 861 946,51	0,43
SCANIA CV AB 0.5% 06-10-23	EUR	1 000 000	994 717,33	0,23
VOLVO TREASURY AB 3.5% 17-11-25	EUR	1 400 000	1 402 165,78	0,33
<b>TOTAL SUEDE</b>			<b>6 222 042,42</b>	<b>1,44</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>392 926 706,51</b>	<b>90,76</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées</b>			<b>392 926 706,51</b>	<b>90,76</b>
<b>Titres de créances</b>				
<b>Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>FRANCE</b>				
FRANCE TREASURY BILL ZCP 210224	EUR	20 000 000	19 538 299,14	4,51
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>19 538 299,14</b>	<b>4,51</b>
<b>TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>19 538 299,14</b>	<b>4,51</b>
<b>TOTAL Titres de créances</b>			<b>19 538 299,14</b>	<b>4,51</b>
<b>Organismes de placement collectif</b>				
<b>OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>				
<b>FRANCE</b>				
RMM COURT TERME C	EUR	6 370	25 292 212,40	5,84
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>25 292 212,40</b>	<b>5,84</b>
<b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>			<b>25 292 212,40</b>	<b>5,84</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>25 292 212,40</b>	<b>5,84</b>
<b>Créances</b>			<b>3 074 208,19</b>	<b>0,71</b>
<b>Dettes</b>			<b>-9 951 275,34</b>	<b>-2,29</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>2 055 406,59</b>	<b>0,47</b>
<b>Actif net</b>			<b>432 935 557,49</b>	<b>100,00</b>

Parts R-CO CONVICTION CREDIT SD EURO C EUR	EUR	794 875,588340	156,02
Parts R-CO CONVICTION CREDIT SD EURO D EUR	EUR	1 076 504,603150	102,44
Parts R-CO CONVICTION CREDIT SD EURO ID EUR	EUR	81,4918	102 215,04
Parts R-CO CONVICTION CREDIT SD EURO I EUR	EUR	1 769,1853	107 571,70