

R-co Conviction Credit 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 28 juin 2024

R-co Conviction Credit 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 28 juin 2024

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 Credit Euro au 28 juin 2024 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 du compartiment R-co Conviction Credit Euro 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 intervention. 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 du compartiment R-co Conviction Credit Euro acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

A Paris La Défense, le 30 juillet 2024

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés


Olivier GALIENNE

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/24

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

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

0 -ACTIONS & VALEURS ASSIMILEES

ACTIONS & VALEURS ASSIMILEES NEGOCIEES SUR UN MARCHÉ REGLEMENTE OU ASSIMILE

ACTIONS & VALEURS ASSIMILEES NEGOCIEES SUR UN MARCHÉ REGLEMENTE OU ASSIMILE

DEVISE VALEUR : EUR EURO

ES0105200416	ABENGOA -CL A		1,228,837.	P EUR	0.	M 24/05/22	0.	V	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
ES0105200002	ABENGOA SA-B SH		12,706,492.	P EUR	0.	M 24/05/22	0.	V	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
FR001400NLM4	ORPEA		164,767.	P EUR	59.4807	M 28/06/24	11.486	T	9,800,459.66	1,892,513.76	0.00	-7,907,945.90	0.07
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO													
CUMUL (EUR)									9,800,459.66	1,892,513.76	0.00	-7,907,945.90	0.07

ACTIONS & VALEURS ASSIMILEES NON NEGOCIEES SUR UN MARCHÉ REGLEMENTE OU ASSIMILE

WARRANTS SUR ACTIONS NON NEGOCIES SUR UN MARCHÉ REGLEMENTE OU ASSIMILE

DEVISE VALEUR : EUR EURO

XFC500X3EKC7	SFP 2020 CMC RAVENNA		1,342,565.	P EUR	0.	M		A	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
CUMUL (EUR)									9,800,459.66	1,892,513.76	0.00	-7,907,945.90	0.07

0 -ACTIONS & VALEURS ASSIMILEES

I -OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES

OBLIGATIONS CONVERTIBLES NEGOCIEES SUR UN MARCHÉ REGLEMENTE

OBLIGATIONS CONVERTIBLES NEGOCIEES SUR UN MARCHÉ REGLEMENTE

DEVISE VALEUR : EUR EURO

XS1978209002	ABEN AB 1.5 10-24	(EUR) 261024	4,738,730.	P EUR	0.	M 28/06/24	0.	E	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
XS1978210273	ABEN AB 1.5 10-24	(EUR) 261024	4,738,730.	P EUR	0.	M 28/06/24	0.	E	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO													
CUMUL (EUR)									0.00	0.00	0.00	0.00	

AUTRES OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES NEGOCIEES SUR UN MARCHÉ REGLEMENTE

OBLIGATIONS A TAUX FIXE NEGOCIEES SUR UN MARCHÉ REGLEMENTE

DEVISE VALEUR : EUR EURO

XS2626289222	3I GROU 4.875 06-29	(366) 140629	17,500,000.	M EUR	98.506	% 28/06/24	103.163	4	17,238,550.00	18,095,596.92	42,071.92	857,046.92	0.63
DE000A254YS5	ACCE RE 3.625 02-26	(UST) 130226	5,903,000.	M EUR	83.5813	% 28/06/24	40.527	E	4,440,423.63	2,268,016.15	114,938.22	-2,172,407.48	0.08
XS2351301499	ACEF HO 0.75 06-28	(366) 140628	4,350,000.	M EUR	99.364	% 28/06/24	88.0925	4	4,322,334.00	3,833,632.65	1,608.90	-488,701.35	0.13
ES0200002089	ADIF AL 3.9 04-33	(366) 300433	23,000,000.	M EUR	99.8104	% 28/06/24	101.7705	4	22,956,382.00	23,562,039.66	154,824.66	605,657.66	0.81
ES0205046008	AENA 4.25 10-30	(366) 131030	5,400,000.	M EUR	99.62	% 28/06/24	103.697	E	5,379,480.00	5,764,551.93	164,913.93	385,071.93	0.20
FR0012317451	AGRIPOLE 5.0 11-19	(366) 271119	1,800,000.	M EUR	100.	% 16/12/19	0.	R	1,800,000.00	0.00	0.00	-1,800,000.00	0.00
FR001400F2R8	AIR FR 8.125 05-28	(366) 310528	8,800,000.	M EUR	99.547	% 28/06/24	110.824	4	8,760,136.00	9,815,196.93	62,684.93	1,055,060.93	0.34
XS2341269970	AKER BP 1.125 05-29	(366) 120529	6,000,000.	M EUR	99.356	% 28/06/24	88.625	4	5,961,360.00	5,326,931.51	9,431.51	-634,428.49	0.18
XS2498554992	ALD 4.0 07-27	(366) 050727	4,000,000.	M EUR	101.8269	% 28/06/24	100.882	4	4,073,076.71	4,193,968.52	158,688.52	120,891.81	0.14
BE6331562817	ALIA FI 0.875 11-28	(366) 081128	12,000,000.	M EUR	97.9179	% 28/06/24	87.9775	4	11,750,151.97	10,625,291.80	67,991.80	-1,124,860.17	0.37
FR0013346814	ALTA 2.875 07-25	(366) 020725	9,300,000.	M EUR	99.265	% 28/06/24	97.55	4	9,231,645.00	9,072,150.00	0.00	-159,495.00	0.31
FR0013453974	ALTA CO 1.875 01-28	(366) 170128	12,600,000.	M EUR	93.1581	% 28/06/24	90.587	4	11,737,919.75	11,521,759.13	107,797.13	-216,160.62	0.40
XS2331921390	ANIMA 1.5 04-28	(366) 220428	5,450,000.	M EUR	99.408	% 28/06/24	91.7265	4	5,417,736.00	5,014,996.30	15,902.05	-402,739.70	0.17
FR0013455862	APIC PR 4.0 10-29	(366) 241029	7,900,000.	M EUR	100.0886	% 28/06/24	94.256	E	7,907,000.00	7,663,797.77	217,573.77	-243,202.23	0.26
XS2594025814	ARCA NV 4.875 02-28	(366) 280228	6,800,000.	M EUR	99.3082	% 28/06/24	103.013	4	6,752,955.26	7,118,101.21	113,217.21	365,145.95	0.25
XS2694995163	ASR NED 3.625 12-28	(366) 121228	5,100,000.	M EUR	99.601	% 28/06/24	100.064	E	5,079,651.00	5,205,803.96	102,539.96	126,152.96	0.18

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/24

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 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		
XS2294495838	ATRI FI	2.625 09-27	(366)	050927	1,500,000.	M	EUR	98.167	%	28/06/24	84.7925	4	1,472,505.00	1,304,269.67	32,382.17	-168,235.33	0.05
XS2776519980	AUST PA	4.0 06-34	(366)	070634	28,400,000.	M	EUR	99.833	%	28/06/24	100.4425	E	28,352,572.00	28,603,478.22	77,808.22	250,906.22	0.99
XS2267889991	AUTO PE	2.0 12-28	(366)	041228	4,500,000.	M	EUR	85.3962	%	28/06/24	92.163	4	3,842,830.55	4,199,220.25	51,885.25	356,389.70	0.15
XS2825539617	AVIN AS	3.5 05-34	(366)	290534	36,750,000.	M	EUR	99.511	%	28/06/24	98.407	4	36,570,292.50	36,284,387.57	119,815.07	-285,904.93	1.25
FR001400F6E7	AYVENS	4.25 01-27	(366)	180127	8,000,000.	M	EUR	101.2329	%	28/06/24	101.3235	4	8,098,630.14	8,260,087.65	154,207.65	161,457.51	0.29
XS2434421413	BANC BP	3.375 01-32	(366)	190132	7,000,000.	M	EUR	99.521	%	28/06/24	96.2435	4	6,966,470.00	6,843,551.15	106,506.15	-122,918.85	0.24
XS2577572188	BANC BP	4.875 01-27	(366)	180127	15,126,000.	M	EUR	102.1046	%	28/06/24	102.486	4	15,444,348.44	15,836,478.14	334,445.78	392,129.70	0.55
XS2247936342	BANC SA	1.625 10-30	(366)	221030	5,000,000.	M	EUR	98.8751	%	28/06/24	86.13	4	4,943,756.85	4,362,886.61	56,386.61	-580,870.24	0.15
XS2662538425	BARC	4.918 08-30	(366)	080830	20,000,000.	M	EUR	99.8884	%	28/06/24	104.0915	4	19,977,686.33	21,702,465.03	884,165.03	1,724,778.70	0.75
XS1385945131	BFCM	2.38 03-26	(366)	240326	10,000,000.	M	EUR	108.9094	%	28/06/24	97.574	4	10,890,939.72	9,822,468.49	65,068.49	-1,068,471.23	0.34
FR0014001168	BFCM BA	0.25 07-28	(366)	190728	15,000,000.	M	EUR	99.711	%	28/06/24	86.69	4	14,956,650.00	13,039,258.20	35,758.20	-1,917,391.80	0.45
XS2247718435	BLAC PR	1.25 04-27	(366)	260427	10,000,000.	M	EUR	89.4185	%	28/06/24	91.7525	4	8,941,849.32	9,198,195.21	22,945.21	256,345.89	0.32
XS2621007660	BOOK	4.125 05-33	(366)	120533	17,800,000.	M	EUR	99.43	%	28/06/24	102.8205	4	17,698,540.00	18,404,642.84	102,593.84	706,102.84	0.64
DE0001102473	BUND DE	0.0 08-29	(366)	150829	210,000,000.	M	EUR	87.977	%	28/06/24	88.4845	4	184,751,700.00	185,817,450.00	0.00	1,065,750.00	6.42
IT0005584260	Banc If	5.5 02-29	(366)	270229	2,000,000.	M	EUR	103.0835	%	28/06/24	101.039	4	2,061,670.82	2,058,648.85	37,868.85	-3,021.97	0.07
IT0005561367	Banc If	6.875 09-28	(366)	130928	23,250,000.	M	EUR	100.	%	28/06/24	105.756	E	23,250,000.00	25,867,893.46	1,279,623.46	2,617,893.46	0.89
XS2708354811	CA AUTO	4.75 01-27	(366)	250127	17,450,000.	M	EUR	99.932	%	28/06/24	102.4065	4	17,438,134.00	18,230,019.29	360,085.04	791,885.29	0.63
XS2751688826	CARR GL	4.125 05-28	(366)	290528	5,000,000.	M	EUR	99.687	%	28/06/24	101.892	4	4,984,350.00	5,113,812.33	19,212.33	129,462.33	0.18
FR0013523602	CASA AS	2.0 07-30	(366)	170730	14,000,000.	M	EUR	88.2205	%	28/06/24	86.8285	4	12,350,875.94	12,424,514.59	268,524.59	73,638.65	0.43
XS2049767598	CAST AB	0.75 09-26	(366)	040926	2,000,000.	M	EUR	81.7905	%	28/06/24	93.2585	4	1,635,810.68	1,877,547.05	12,377.05	241,736.37	0.06
XS2387052744	CAST HE	0.875 09-29	(366)	170929	200,000.	M	EUR	72.3006	%	28/06/24	82.558	4	144,601.28	166,497.83	1,381.83	21,896.55	0.01
XS2300292963	CELL FI	1.25 01-29	(366)	150129	14,400,000.	M	EUR	91.297	%	28/06/24	89.743	4	13,146,771.15	13,006,106.75	83,114.75	-140,664.40	0.45
XS2465792294	CELL FI	2.25 04-26	(366)	120426	5,000,000.	M	EUR	99.0718	%	28/06/24	97.593	4	4,953,590.00	4,904,615.75	24,965.75	-48,974.25	0.17
XS2468979302	CETI FI	3.125 04-27	(366)	140427	18,000,000.	M	EUR	98.0607	%	28/06/24	97.4395	4	17,650,923.01	17,660,856.58	121,746.58	9,933.57	0.61
XS2310411090	CITY TR	1.625 03-28	(366)	120328	3,000,000.	M	EUR	98.898	%	28/06/24	85.6375	4	2,966,940.00	2,584,083.90	14,958.90	-382,856.10	0.09
XS2778383898	CITY TR	6.5 03-29	(366)	080329	4,000,000.	M	EUR	99.482	%	28/06/24	100.177	E	3,979,280.00	4,089,710.14	82,630.14	110,430.14	0.14
IT0005440646	CMC RAV	2.0 12-26	(366)	311226	671,283.	M	EUR	20.2132	%	28/06/24	0.	C	135,687.50	0.00	0.00	-135,687.50	0.00
DE000CZ40LD5	CMZB FRA	4.0 03-26	(366)	230326	10,000,000.	M	EUR	110.5395	%	28/06/24	99.9845	4	11,053,945.21	10,109,134.93	110,684.93	-944,810.28	0.35
FR0014007YA9	CNP ASS	1.25 01-29	(366)	270129	15,900,000.	M	EUR	87.703	%	28/06/24	88.4655	4	13,944,777.40	14,151,270.65	85,256.15	206,493.25	0.49
XS2572996606	COOP RA	4.0 01-30	(366)	100130	17,100,000.	M	EUR	99.575	%	28/06/24	102.169	4	17,027,325.00	17,796,079.33	325,180.33	768,754.33	0.61
XS2621757405	CORN	3.875 05-26	(366)	150526	18,350,000.	M	EUR	99.986	%	28/06/24	100.0645	4	18,347,431.00	18,455,345.34	93,509.59	107,914.34	0.64
FR0014004Q15	COVI HO	1.0 07-29	(366)	270729	3,600,000.	M	EUR	99.519	%	28/06/24	86.256	4	3,582,684.00	3,138,756.98	33,540.98	-443,927.02	0.11
XS2815976126	CPI PRO	7.0 05-29	(366)	070529	22,800,000.	M	EUR	96.1356	%	28/06/24	98.3295	E	21,918,926.03	22,663,991.75	244,865.75	745,065.72	0.78
FR0014001186	CRED MU	3.875 05-28	(366)	220528	10,300,000.	M	EUR	99.862	%	28/06/24	100.948	4	10,285,786.00	10,442,477.22	44,833.22	156,691.22	0.36
XS2345982362	CRED SU	0.25 01-26	(366)	050126	5,800,000.	M	EUR	86.0411	%	28/06/24	95.0065	4	4,990,383.56	5,517,468.53	7,091.53	527,084.97	0.19
XS2589907653	CRED SU	5.5 08-26	(366)	200826	5,000,000.	M	EUR	99.708	%	28/06/24	103.867	4	4,985,400.00	5,431,533.06	238,183.06	446,133.06	0.19
FR0014000UR2	CRHC DE	2.875 03-31	(366)	250331	10,000,000.	M	EUR	98.9244	%	28/06/24	98.1005	4	9,892,441.10	9,888,029.45	77,979.45	-4,411.65	0.34
XS2792575453	CT INVE	6.375 04-30	(EUR)	150430	5,000,000.	M	EUR	100.	%	28/06/24	101.9165	E	5,000,000.00	5,172,856.25	77,031.25	172,856.25	0.18
XS2597671051	CYR	6.3 03-26	(366)	230326	9,200,000.	M	EUR	103.045	%	28/06/24	101.97	E	9,480,141.87	9,541,622.47	160,382.47	61,480.60	0.33
XS2382953789	CZEC GA	0.45 09-29	(366)	080929	11,800,000.	M	EUR	73.2813	%	28/06/24	84.0975	4	8,647,195.26	9,966,739.43	43,234.43	1,319,544.17	0.34
XS2545259876	DELL BA	4.5 10-27	(366)	181027	12,650,000.	M	EUR	99.645	%	28/06/24	102.422	4	12,605,092.50	13,357,657.59	401,274.59	752,565.09	0.46
DE000A30WV1	DEUT PF	4.375 08-26	(366)	280826	15,800,000.	M	EUR	99.921	%	28/06/24	96.8965	4	15,787,518.00	15,893,243.31	583,596.31	105,725.31	0.55
XS2236273582	DZ BANK	1.026 09-30	(366)	230930	6,700,000.	M	EUR	100.	%	28/06/24	78.006	E	6,700,000.00	5,279,554.97	53,152.97	-1,420,445.03	0.18
XS1410582313	EADS FIN	1.38 05-31	(366)	130531	30,000,000.	M	EUR	84.0074	%	28/06/24	87.778	4	25,202,217.22	26,389,906.85	56,506.85	1,187,689.63	0.91
XS2306601746	EASY FI	1.875 03-28	(366)	030328	10,000,000.	M	EUR	93.8629	%	28/06/24	93.522	4	9,386,286.91	9,414,357.53	62,157.53	28,070.62	0.33
FR0014001IU3	EDENRED	3.625 06-31	(366)	130631	21,500,000.	M	EUR	100.0255	%	28/06/24	98.8485	4	21,505,481.34	21,292,997.71	40,570.21	-212,483.63	0.74
FR001400M9L7	EDF	3.75 06-27	(366)	050627	10,500,000.	M	EUR	99.776	%	28/06/24	100.4005	4	10,476,480.00	10,571,179.21	29,126.71	94,699.21	0.37
XS2540585564	ELEC AB	4.125 10-26	(366)	051026	2,000,000.	M	EUR	104.0455	%	28/06/24	100.5765	4	2,080,910.96	2,072,616.07	61,086.07	-8,294.89	0.07

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/24

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 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	
XS2698045130	ELEC AB 4.5 09-28	(366) 290928	25,000,000.	M EUR	99.0664	% 28/06/24	101.799	4	24,766,598.36	26,301,184.43	851,434.43	1,534,586.07	0.91
FR001400AK26	ELIS EX 4.125 05-27	(366) 240527	500,000.	M EUR	99.5002	% 28/06/24	100.1565	4	497,501.23	502,986.27	2,203.77	5,485.04	0.02
XS2353182020	ENEL FI 0.25 06-27	(366) 170627	15,000,000.	M EUR	98.909	% 28/06/24	90.902	4	14,836,350.00	13,636,841.10	1,541.10	-1,199,508.90	0.47
XS2000538343	ERST GR 0.875 05-26	(366) 220526	4,000,000.	M EUR	99.501	% 28/06/24	95.149	4	3,980,040.00	3,809,891.51	3,931.51	-170,148.49	0.13
BE6343437255	ETHI VI 6.75 05-33	(366) 050533	8,700,000.	M EUR	114.9258	% 28/06/24	109.3065	4	9,998,546.37	9,602,981.94	93,316.44	-395,564.43	0.33
BE6279619330	ETHI VIE 5.0 01-26	(366) 140126	7,100,000.	M EUR	106.7022	% 28/06/24	101.196	4	7,575,859.25	7,349,806.71	164,890.71	-226,052.54	0.25
XS2001315766	EURO WO 1.375 05-26	(366) 220526	9,600,000.	M EUR	100.8724	% 28/06/24	95.2655	4	9,683,749.79	9,160,315.40	14,827.40	-523,434.39	0.32
XS1794675931	FAIR FI 2.75 03-28	(366) 290328	4,300,000.	M EUR	111.8174	% 28/06/24	95.4965	4	4,808,148.08	4,137,126.90	30,777.40	-671,021.18	0.14
XS2050448336	FAST AB 1.125 01-27	(366) 290127	7,800,000.	M EUR	99.839	% 28/06/24	90.721	4	7,787,442.00	7,113,399.89	37,161.89	-674,042.11	0.25
FR001400D4D6	FINA AP 7.0 10-27	(366) 061027	2,400,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	103.2705	E	2,400,000.00	2,602,426.43	123,934.43	202,426.43	0.09
XS2805234700	FLUT TR 5.0 04-29	(EUR) 290429	4,500,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	101.6925	4	4,500,000.00	4,615,537.50	39,375.00	115,537.50	0.16
XS1829325239	G CITY 4.25 09-25	(366) 110925	5,000,000.	M EUR	98.457	% 28/06/24	96.4795	4	4,922,850.00	4,995,252.32	171,277.32	72,402.32	0.17
PTGGDDOM0008	GALP GA 4.875 07-28	(366) 030728	18,300,000.	M EUR	99.8	% 28/06/24	102.673	4	18,263,400.00	19,678,846.50	889,687.50	1,415,446.50	0.68
XS0816246077	GE 3.65 08/23/32	(366) 230832	5,300,000.	M EUR	126.92	% 28/06/24	97.2775	E	6,726,760.00	5,321,672.80	165,965.30	-1,405,087.20	0.18
XS2155486942	GREN FI 3.95 07-25	(366) 090725	7,100,000.	M EUR	105.9409	% 28/06/24	99.6525	4	7,521,803.22	7,350,413.70	275,086.20	-171,389.52	0.25
XS2828685631	GREN FI 5.75 07-29	(366) 060729	17,550,000.	M EUR	100.3413	% 28/06/24	101.079	E	17,609,891.56	17,827,594.01	88,229.51	217,702.45	0.62
FR0013232444	GROU AS 6.0 01-27	(366) 230127	8,700,000.	M EUR	109.9501	% 28/06/24	104.8485	4	9,565,655.65	9,351,442.45	229,622.95	-214,213.20	0.32
BE0002938190	GROU BR 4.0 05-33	(366) 150533	20,000,000.	M EUR	99.66	% 28/06/24	102.1045	4	19,932,000.00	20,526,105.48	105,205.48	594,105.48	0.71
XS2747270630	Gene Mo 3.9 01-28	(366) 120128	9,300,000.	M EUR	99.945	% 28/06/24	100.372	E	9,294,885.00	9,505,045.18	170,449.18	210,160.18	0.33
DE000HCB0B36	HAMB CO 4.75 05-29	(366) 020529	14,800,000.	M EUR	99.8556	% 28/06/24	101.813	4	14,778,628.00	15,185,811.67	117,487.67	407,183.67	0.52
DE000HCB0BS6	HAMB CO 4.875 03-25	(366) 170325	16,900,000.	M EUR	99.948	% 28/06/24	100.1895	4	16,891,212.00	17,173,545.02	241,519.52	282,333.02	0.59
SE0015657903	HEIM AB 4.25 03-26	(EUR) 090326	1,600,000.	M EUR	98.892	% 28/06/24	73.801	4	1,582,272.00	1,202,160.44	21,344.44	-380,111.56	0.04
SE0016589105	HEIM AB 4.375 03-27	(EUR) 060327	4,800,000.	M EUR	99.397	% 28/06/24	70.0895	4	4,771,056.00	3,431,962.67	67,666.67	-1,339,093.33	0.12
DE000A30VGD9	HERA FI 2.625 06-27	(366) 090627	15,100,000.	M EUR	99.727	% 28/06/24	97.0625	4	15,058,777.00	14,681,414.55	24,977.05	-377,362.45	0.51
XS2385390724	HIME SA 0.625 09-28	(366) 160928	13,000,000.	M EUR	83.2206	% 28/06/24	85.111	4	10,818,673.36	11,128,808.42	64,378.42	310,135.06	0.38
XS2608828641	HOLD D 4.5 04-27	(366) 060427	14,250,000.	M EUR	100.2199	% 28/06/24	99.4925	4	14,281,336.60	14,330,527.14	152,845.89	49,190.54	0.50
XS2577384691	HOLD IN 4.25 03-30	(366) 180330	5,300,000.	M EUR	99.103	% 28/06/24	100.9715	4	5,252,459.00	5,416,904.57	65,415.07	164,445.57	0.19
XS2748213290	IBER FI 4.871 PERP	(366) 311299	15,600,000.	M EUR	100.0516	% 28/06/24	101.582	4	15,608,056.00	16,007,094.61	160,302.61	399,038.61	0.55
XS2587104444	IM GROU 8.0 03-28	(EUR) 010328	7,600,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	74.446	4	7,600,000.00	5,838,607.11	180,711.11	-1,761,392.89	0.20
XS2243564478	IMMO AG 2.5 10-27	(366) 151027	4,500,000.	M EUR	97.856	% 28/06/24	87.5015	4	4,403,520.00	4,017,792.91	80,225.41	-385,727.09	0.14
FR001400LCK1	INDI GR 4.5 04-30	(366) 180430	15,000,000.	M EUR	102.7008	% 28/06/24	102.1595	4	15,405,122.95	15,462,623.63	138,698.63	57,500.68	0.53
XS2244936659	INFR WI 1.625 10-28	(366) 201028	4,450,000.	M EUR	99.755	% 28/06/24	92.218	4	4,439,097.50	4,154,082.66	50,381.66	-285,014.84	0.14
XS2081018629	INTE 1.0 11-26	(366) 191126	20,000,000.	M EUR	102.5711	% 28/06/24	93.979	4	20,514,226.03	18,919,297.27	123,497.27	-1,594,928.76	0.65
XS2835773255	INTL PE 10.75 12-29	(UST) 141229	6,000,000.	M EUR	99.493	% 28/06/24	103.739	4	5,969,580.00	6,256,061.31	31,721.31	286,481.31	0.22
FR0013367174	IPSOS 2.875 09-25	(366) 210925	3,000,000.	M EUR	99.184	% 28/06/24	98.302	E	2,975,520.00	3,016,221.89	67,161.89	40,701.89	0.10
XS2625194225	Indu Po 4.75 06-30	(366) 010630	20,000,000.	M EUR	99.772	% 28/06/24	102.985	4	19,954,393.98	20,677,684.93	80,684.93	723,290.95	0.71
DE000A2SBDE0	JAB HOL 1.0 12-27	(366) 201227	2,400,000.	M EUR	99.018	% 28/06/24	91.643	4	2,376,432.00	2,212,218.89	12,786.89	-164,213.11	0.08
XS2728561098	JDE PEE 4.125 01-30	(366) 230130	9,100,000.	M EUR	99.49	% 28/06/24	101.041	E	9,053,590.00	9,359,854.98	165,123.98	306,264.98	0.32
XS2168693385	JPMO CH 3.4 02-29	(EUR) 150229	19,900,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	99.6555	E	19,900,000.00	20,088,928.39	257,483.89	188,928.39	0.69
FR001400KHW7	KERING 3.625 09-31	(366) 050931	18,000,000.	M EUR	97.6862	% 28/06/24	99.96	4	17,583,522.63	18,529,418.85	536,618.85	945,896.22	0.64
FR0013222551	KLES PR 5.375 12-26	(366) 081226	10,700,000.	M EUR	101.6215	% 28/06/24	100.5625	E	10,873,504.03	11,085,463.11	325,275.61	211,959.08	0.38
XS2844398482	KS AKTU 4.25 06-29	(366) 190629	15,400,000.	M EUR	99.147	% 28/06/24	99.827	4	15,268,638.00	15,396,668.96	23,310.96	128,030.96	0.53
XS2852136063	Koni DS 3.625 07-34	(366) 020734	18,400,000.	M EUR	99.456	% 28/06/24	99.1275	4	18,299,904.00	18,239,460.00	0.00	-60,444.00	0.63
FR0014001IS7	LA POST 4.0 06-35	(366) 120635	25,000,000.	M EUR	106.6749	% 28/06/24	102.3665	4	26,646,729.24	25,646,419.52	54,794.52	-1,022,309.72	0.89
XS2363989273	LAR ESP 1.75 07-26	(366) 220726	4,200,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	94.338	4	4,200,000.00	4,031,679.61	69,483.61	-168,320.39	0.14
XS2656537664	LEASYS 4.5 07-26	(366) 260726	13,000,000.	M EUR	99.953	% 28/06/24	101.1735	E	12,993,890.00	13,699,194.34	546,639.34	705,304.34	0.47
XS2286012849	LOGI FI 0.875 01-31	(366) 140131	4,900,000.	M EUR	98.901	% 28/06/24	78.995	4	4,846,149.00	3,890,669.62	19,914.62	-955,479.38	0.13
XS2027364327	LOGI FI 1.625 07-27	(366) 150727	3,500,000.	M EUR	106.6029	% 28/06/24	92.26	4	3,731,100.68	3,283,954.85	54,854.85	-447,145.83	0.11

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/24

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 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	
XS2753547673	LOGI FI	4.625 07-28	(366)	250728	5,050,000.	M	EUR	99.807	% 28/06/24	100.6805	4	5,040,253.50	5,185,830.93	101,465.68	145,577.43	0.18
XS2723556572	MACQ GR	4.747 01-30	(366)	230130	24,600,000.	M	EUR	101.7006	% 28/06/24	104.5055	E	25,018,356.97	26,222,051.48	513,698.48	1,203,694.51	0.91
ES0224244105	MAPFRE	2.875 04-30	(366)	130430	8,000,000.	M	EUR	99.06	% 28/06/24	92.8855	4	7,924,800.00	7,481,250.96	50,410.96	-443,549.04	0.26
FR0014008J04	MERC	2.5 02-29	(366)	280229	5,000,000.	M	EUR	99.399	% 28/06/24	92.66	4	4,969,950.00	4,675,465.75	42,465.75	-294,484.25	0.16
XS2838537566	MOTA OP	4.0 01-30	(366)	170130	18,650,000.	M	EUR	99.857	% 28/06/24	101.2315	E	18,623,330.50	18,910,248.52	30,573.77	286,918.02	0.65
DE000MHB66N7	MUEN HY	7.125 10-28	(366)	311028	16,400,000.	M	EUR	99.49	% 28/06/24	101.896	4	16,316,360.00	17,493,136.62	782,192.62	1,176,776.62	0.60
XS2203802462	NE PROP	3.375 07-27	(366)	140727	5,000,000.	M	EUR	100.8822	% 28/06/24	97.3045	4	5,044,109.59	5,028,442.21	163,217.21	-15,667.38	0.17
XS2362994068	NEMA SA	2.25 07-28	(366)	200728	27,300,000.	M	EUR	89.5529	% 28/06/24	88.2115	4	24,447,937.38	24,665,780.48	584,040.98	217,843.10	0.85
XS2595412631	NEST FI	3.75 03-33	(366)	130333	25,000,000.	M	EUR	99.435	% 28/06/24	104.0365	4	24,858,750.00	26,294,227.74	285,102.74	1,435,477.74	0.91
XS2713801780	NI BC BA	6.0 11-28	(366)	161128	18,000,000.	M	EUR	100.4776	% 28/06/24	106.874	4	18,085,965.91	19,913,057.70	675,737.70	1,827,091.79	0.69
DK0030512421	NYKR	4.625 01-29	(366)	190129	28,100,000.	M	EUR	99.516	% 28/06/24	103.3715	4	27,963,996.00	29,633,288.02	585,896.52	1,669,292.02	1.02
XS2241400295	OCI NV	3.625 10-25	(EUR)	151025	21,500,000.	M	EUR	98.9415	% 28/06/24	99.105	4	19,145,182.50	19,326,847.19	150,029.69	181,664.69	0.67
FR001400DA04	ORANO	5.375 05-27	(366)	150527	6,600,000.	M	EUR	99.7	% 28/06/24	103.509	4	6,580,200.00	6,878,246.05	46,652.05	298,046.05	0.24
XS1489391109	PART IR	1.25 09-26	(366)	150926	6,100,000.	M	EUR	104.7815	% 28/06/24	94.8635	4	6,391,672.29	5,847,298.50	60,625.00	-544,373.79	0.20
XS2361342889	PICA GR	3.875 07-26	(EUR)	010726	18,990,000.	M	EUR	97.8623	% 28/06/24	99.8185	4	18,584,041.92	18,990,282.21	34,749.06	406,240.29	0.66
XS2847641961	PIRE C	3.875 07-29	(366)	020729	10,100,000.	M	EUR	99.666	% 28/06/24	99.7605	4	10,066,266.00	10,075,810.50	0.00	9,544.50	0.35
XS2484340075	PPG IND	2.75 06-29	(366)	010629	9,000,000.	M	EUR	99.735	% 28/06/24	96.189	4	8,976,150.00	8,678,030.55	21,020.55	-298,119.45	0.30
FR0013535150	PRAE HE	1.375 09-30	(366)	170930	2,000,000.	M	EUR	99.926	% 28/06/24	83.8435	4	1,998,520.00	1,698,584.48	21,714.48	-299,935.52	0.06
XS2430287529	PROS NV	1.207 01-26	(366)	190126	6,050,000.	M	EUR	91.8658	% 28/06/24	95.778	4	5,557,877.99	5,827,489.43	32,920.43	269,611.44	0.20
XS2360853332	PROS NV	1.288 07-29	(366)	130729	12,800,000.	M	EUR	86.5188	% 28/06/24	85.835	4	11,074,403.02	11,146,789.07	159,909.07	72,386.05	0.39
XS2430287362	PROS NV	2.085 01-30	(366)	190130	12,600,000.	M	EUR	93.8458	% 28/06/24	87.812	4	11,824,570.43	11,182,746.84	118,434.84	-641,823.59	0.39
XS2494945939	RENT IN	3.875 06-27	(366)	270627	4,800,000.	M	EUR	99.586	% 28/06/24	100.593	4	4,780,128.00	4,831,011.95	2,547.95	50,883.95	0.17
FR001400J150	RTE EDF	3.75 07-35	(366)	040735	18,800,000.	M	EUR	103.5869	% 28/06/24	99.536	4	19,474,341.31	19,413,915.54	701,147.54	-60,425.77	0.67
DE000A3823S1	SCHA AG	4.75 08-29	(366)	140829	8,800,000.	M	EUR	99.429	% 28/06/24	100.8405	4	8,749,752.00	9,066,974.93	193,010.93	317,222.93	0.31
XS2607381436	SECU TR	4.25 04-27	(366)	040427	7,500,000.	M	EUR	99.9865	% 28/06/24	101.3635	4	7,498,988.20	7,679,985.10	77,722.60	180,996.90	0.27
XS2015240083	SELP FI	1.5 12-26	(366)	201226	3,700,000.	M	EUR	99.672	% 28/06/24	94.258	4	3,687,864.00	3,517,115.67	29,569.67	-170,748.33	0.12
XS2634690114	STEL NV	4.25 06-31	(366)	160631	2,500,000.	M	EUR	99.4857	% 28/06/24	101.8275	4	2,487,142.62	2,550,345.03	4,657.53	63,202.41	0.09
XS2613209670	SYDN AI	4.375 05-33	(366)	030533	23,400,000.	M	EUR	99.5605	% 28/06/24	103.587	4	23,297,155.00	24,407,645.67	168,287.67	1,110,490.67	0.84
XS2484502823	TDC NET	5.056 05-28	(366)	310528	17,000,000.	M	EUR	99.2631	% 28/06/24	102.061	4	16,874,719.52	17,425,725.18	75,355.18	551,005.66	0.60
XS2807518639	TDC NET	5.186 08-29	(366)	020829	9,400,000.	M	EUR	99.997	% 28/06/24	101.5825	4	9,399,718.00	9,630,224.93	81,469.93	230,506.93	0.33
FR0014006T07	TDF INF	1.75 12-29	(366)	011229	6,000,000.	M	EUR	99.616	% 28/06/24	87.918	4	5,976,960.00	5,336,473.44	61,393.44	-640,486.56	0.18
XS2347284742	TECH EN	1.125 05-28	(366)	280528	16,325,000.	M	EUR	96.8714	% 28/06/24	90.5975	4	15,814,254.62	14,807,652.75	17,610.87	-1,006,601.87	0.51
XS2049419398	TEOL VO	1.125 03-26	(366)	090326	3,700,000.	M	EUR	99.691	% 28/06/24	95.4945	4	3,688,567.00	3,546,411.23	13,114.73	-142,155.77	0.12
FR001400L263	THAL SE	4.25 10-31	(366)	181031	16,000,000.	M	EUR	98.5419	% 28/06/24	103.1665	4	15,766,697.92	16,985,984.26	479,344.26	1,219,286.34	0.59
FR0013452893	TIKE CA	2.25 10-26	(366)	141026	4,300,000.	M	EUR	99.859	% 28/06/24	96.1445	4	4,293,937.00	4,203,471.70	69,258.20	-90,465.30	0.15
FR001400KX9	TIKE CA	6.625 03-30	(366)	140330	4,300,000.	M	EUR	111.4161	% 28/06/24	108.9455	4	4,790,890.20	4,770,509.24	85,852.74	-20,380.96	0.16
XS2293733825	TRAF FU	3.875 02-26	(366)	020226	22,550,000.	M	EUR	97.2573	% 28/06/24	98.6605	4	21,931,520.73	22,608,450.09	360,507.34	676,929.36	0.78
XS2778764006	TRAN FI	3.713 03-32	(366)	120332	18,850,000.	M	EUR	100.0132	% 28/06/24	99.9095	4	18,852,493.42	19,047,704.74	214,763.99	195,211.32	0.66
DE000A3LHK72	TRAT FI	4.0 09-25	(366)	160925	19,100,000.	M	EUR	99.5866	% 28/06/24	100.075	4	19,021,042.79	19,719,680.19	605,355.19	698,637.40	0.68
DE000A3LHK80	TRAT FI	4.25 05-28	(366)	160528	10,000,000.	M	EUR	100.3115	% 28/06/24	101.377	4	10,031,147.54	10,192,426.03	54,726.03	161,278.49	0.35
BE0390119825	UCB	4.25 03-30	(366)	200330	11,200,000.	M	EUR	99.482	% 28/06/24	99.8835	4	11,141,984.00	11,322,579.40	135,627.40	180,595.40	0.39
FR0013430840	UMG GRO	1.625 07-29	(366)	020729	8,000,000.	M	EUR	104.7119	% 28/06/24	89.633	4	8,376,955.54	7,170,640.00	0.00	-1,206,315.54	0.25
XS2599156192	VAR ENE	5.5 05-29	(366)	040529	20,000,000.	M	EUR	100.4904	% 28/06/24	105.7955	4	20,098,075.21	21,336,908.22	177,808.22	1,238,833.01	0.74
BE6327721237	VGP	1.5 04-29	(366)	080429	8,100,000.	M	EUR	99.522	% 28/06/24	85.701	4	8,061,282.00	6,970,075.52	28,294.52	-1,091,206.48	0.24
BE6332786449	VGP	1.625 01-27	(366)	170127	12,400,000.	M	EUR	90.4899	% 28/06/24	92.475	4	11,220,752.33	11,558,841.26	91,941.26	338,088.93	0.40
AT000B122080	VOLK WI	0.875 03-26	(366)	230326	10,200,000.	M	EUR	99.456	% 28/06/24	94.728	4	10,144,512.00	9,686,952.58	24,696.58	-457,559.42	0.33
DE000A30VQB2	VONO SE	5.0 11-30	(366)	231130	12,000,000.	M	EUR	100.3995	% 28/06/24	104.538	4	12,047,945.00	12,908,494.43	363,934.43	860,549.43	0.45
XS2054209833	WINT DE	0.84 09-25	(366)	250925	18,100,000.	M	EUR	97.8139	% 28/06/24	96.183	4	17,704,323.13	17,525,853.16	116,730.16	-178,469.97	0.61

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/24

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<-----> PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	<-----> COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET	
FR001400KLT5 WORL 4.125 09-28		(366) 120928	17,000,000.	M EUR	96.0345	% 28/06/24	99.396	4	16,325,863.11	17,460,619.18	563,299.18	1,134,756.07	0.60	
<i>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>														
									CUMUL (EUR)	1,964,119,206.61	1,973,882,777.71	24,966,995.14	9,763,571.10	68.20
<i>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</i>														
N00013182766 SHEA GE 9.5 04-29		(EUR) 030429	15,800,000.	M USD	100.269	% 28/06/24	99.45	4	14,501,144.15	15,024,923.46	346,642.28	523,779.31	0.52	
USG87110AC93 TECH 6.5 02-26		(EUR) 010226	1,598,000.	M USD	100.	% 28/06/24	99.8905	E	1,314,360.91	1,531,554.75	40,428.93	217,193.84	0.05	
<i>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</i>														
									CUMUL (EUR)	15,815,505.06	16,556,478.21	387,071.21	740,973.15	0.57
OBLIGATIONS A TAUX VARIABLE, REVISABLE, CALLABLE NEGOCIEES SUR UN MARCHÉ REGLEMENTE														
<i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>														
XS2729669239 LOTTOMATIC FLR 12-30		(999) 161230	11,900,000.	M EUR	99.5	% 28/06/24	101.4855	4	11,840,500.00	12,151,431.13	74,656.63	310,931.13	0.42	
OBLIGATIONS FIX TO FLOAT														
<i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>														
XS2056490423 ACHM BV 4.625 PERP		(UST) 311299	5,800,000.	M EUR	111.9494	% 28/06/24	90.3765	4	6,493,064.54	5,314,731.02	72,894.02	-1,178,333.52	0.18	
BE6325355822 AGEA NV 1.875 11-51		(366) 241151	6,200,000.	M EUR	99.626	% 28/06/24	82.6285	4	6,176,812.00	5,193,161.67	70,194.67	-983,650.33	0.18	
BE6317598850 AGEA NV 3.875 PERP		(366) 311299	8,000,000.	M EUR	102.1885	% 28/06/24	85.1585	4	8,175,076.16	6,831,364.93	18,684.93	-1,343,711.23	0.24	
XS2230399441 AIB GRO 2.875 05-31		(366) 300531	9,400,000.	M EUR	99.952	% 28/06/24	96.976	4	9,395,488.00	9,140,177.56	24,433.56	-255,310.44	0.32	
XS2808268390 AIB GRO 7.125 PERP		(UST) 311299	7,800,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	100.1755	4	7,800,000.00	7,909,350.89	95,661.89	109,350.89	0.27	
DE000A3E5TRO ALLI SE 2.6 PERP		(366) 311299	7,000,000.	M EUR	100.008	% 28/06/24	75.5455	4	7,000,560.00	5,319,598.70	31,413.70	-1,680,961.30	0.18	
XS2790191303 ASR NED 6.625 PERP		(UST) 311299	16,600,000.	M EUR	100.0054	% 28/06/24	98.3725	E	16,600,900.00	16,621,298.80	291,463.80	20,398.80	0.57	
XS2737652474 AXA 6.375 PERP		(UST) 311299	10,000,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	102.4975	4	10,000,000.00	10,543,980.77	294,230.77	543,980.77	0.36	
XS2284323347 BANC BP 6.5 PERP		(UST) 311299	6,200,000.	M EUR	94.504	% 28/06/24	99.6735	4	5,859,250.00	6,362,435.57	182,678.57	503,185.57	0.22	
IT0005571309 BANC BP 9.5 PERP		(UST) 311299	7,000,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	109.4755	4	7,000,000.00	7,733,760.54	70,475.54	733,760.54	0.27	
XS2455392584 BANC DE 2.625 03-26		(366) 240326	7,000,000.	M EUR	99.9805	% 28/06/24	99.1235	4	6,998,635.00	6,988,987.47	50,342.47	-9,647.53	0.24	
XS2583203950 BANC DE 5.25 02-29		(366) 070229	1,300,000.	M EUR	99.82	% 28/06/24	103.8385	4	1,297,660.00	1,377,125.91	27,225.41	79,465.91	0.05	
XS2545425980 BANC ME 5.035 01-27		(366) 220127	8,300,000.	M EUR	99.994	% 28/06/24	101.7165	4	8,299,502.00	8,627,443.84	184,974.34	327,941.84	0.30	
XS2626699982 BANC NT 5.75 08-33		(366) 230833	20,100,000.	M EUR	99.7088	% 28/06/24	104.289	4	20,041,459.00	21,953,634.08	991,545.08	1,912,175.08	0.76	
XS2817323749 BANC SA 7.0 PERP		(UST) 311299	29,000,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	100.487	4	29,000,000.00	29,378,431.09	237,201.09	378,431.09	1.02	
XS2684974046 BANK MI 9.875 09-27		(366) 180927	18,800,000.	M EUR	100.1097	% 28/06/24	107.403	4	18,820,631.03	21,652,616.46	1,460,852.46	2,831,985.43	0.75	
XS2724428193 BANK PO 5.5 11-27		(366) 231127	8,850,000.	M EUR	99.68	% 28/06/24	102.044	4	8,821,680.00	9,326,135.80	295,241.80	504,455.80	0.32	
XS2342592297 BANQ IN 1.75 08-31		(366) 180831	3,000,000.	M EUR	100.1342	% 28/06/24	89.5625	4	3,004,027.40	2,732,633.20	45,758.20	-271,394.20	0.09	
XS2430951660 BARC O.877 01-28		(366) 280128	3,000,000.	M EUR	88.8632	% 28/06/24	92.976	4	2,665,894.68	2,800,494.10	11,214.10	134,599.42	0.10	
XS1806328750 BAWA GR 5.0 PERP		(UST) 311299	2,400,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	97.2225	4	2,400,000.00	2,349,318.26	15,978.26	-50,681.74	0.08	
XS2573712044 BBVA 4.625 01-31		(366) 130131	14,700,000.	M EUR	99.672	% 28/06/24	103.3485	4	14,651,784.00	15,509,876.02	317,646.52	858,092.02	0.54	
PTBIT30M0098 BCP 3.871 03-30		(366) 270330	10,300,000.	M EUR	98.5954	% 28/06/24	98.664	4	10,155,331.28	10,268,351.35	105,959.35	113,020.07	0.35	
PTBCPKOM0004 BCP 8.125 PERP		(UST) 311299	16,600,000.	M EUR	101.2629	% 28/06/24	101.836	4	16,809,642.86	17,182,677.79	277,901.79	373,034.93	0.59	
PTBCPBOM0062 BCP 8.5 10-25		(366) 271025	7,000,000.	M EUR	100.1257	% 28/06/24	101.298	4	7,008,800.00	7,498,906.45	408,046.45	490,106.45	0.26	
XS2340236327 BK IREL 1.375 08-31		(366) 110831	3,300,000.	M EUR	99.951	% 28/06/24	94.535	4	3,298,383.00	3,160,070.98	40,415.98	-138,312.02	0.11	
XS2065555562 BK IREL 2.375 10-29		(366) 141029	3,200,000.	M EUR	99.972	% 28/06/24	99.377	4	3,199,104.00	3,234,468.37	54,404.37	35,364.37	0.11	
FR0014002X43 BNP PAR O.25 04-27		(366) 130427	8,000,000.	M EUR	90.0841	% 28/06/24	93.917	4	7,206,728.58	7,517,743.56	4,383.56	311,014.98	0.26	
FR001400BBL2 BNP PAR 6.875 PERP		(UST) 311299	13,200,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	102.1295	4	13,200,000.00	13,545,561.21	64,467.21	345,561.21	0.47	
XS2193661324 BP CAP 3.25 PERP		(366) 311299	6,400,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	97.844	4	6,400,000.00	6,267,714.63	5,698.63	-132,285.37	0.22	
FR0014005V34 BPCE 1.5 01-42		(366) 130142	16,800,000.	M EUR	95.6858	% 28/06/24	92.18	4	16,075,221.38	15,603,977.70	117,737.70	-471,243.68	0.54	
FR0014005V67 BPCE 2.125 10-46		(366) 131046	10,000,000.	M EUR	83.9554	% 28/06/24	81.616	4	8,395,538.23	8,314,298.09	152,698.09	-81,240.14	0.29	
FR0014005090 BQ POST 3.0 PERP		(UST) 311299	10,000,000.	M EUR	66.7663	% 28/06/24	77.0625	4	6,676,630.44	7,741,304.35	35,054.35	1,064,673.91	0.27	

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/24

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<-----> PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	<-----> COUPON COURU TOTA	PRCT PLUS OU MOINS VAL ACT NET
FR001400KDS4 CA 5.5 08-33	(366)	280833	20,700,000.	M EUR	102.0151	% 28/06/24	104.1915	4	21,117,135.08	22,528,833.12	961,192.62	1,411,698.04 0.78
FR001400F067 CA 7.25 PERP	(UST)	311299	6,100,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	103.325	4	6,100,000.00	6,313,640.90	10,815.90	213,640.90 0.22
PTCCCMOM0006 CAIX CE 8.375 07-27	(366)	040727	12,000,000.	M EUR	99.681	% 28/06/24	106.5705	4	11,961,720.00	13,787,968.20	999,508.20	1,826,248.20 0.48
XS2585964476 CASS CE 5.885 02-27	(366)	160227	19,750,000.	M EUR	101.8854	% 28/06/24	102.8335	4	20,122,373.97	20,744,680.15	435,063.90	622,306.18 0.72
FR001400QPA3 CCF 9.25 PERP	(UST)	311299	3,000,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	100.6795	4	3,000,000.00	3,035,548.93	15,163.93	35,548.93 0.10
FR0013523891CCR RE 2.875 07-40	(366)	150740	3,000,000.	M EUR	99.529	% 28/06/24	87.1605	4	2,985,870.00	2,698,001.48	83,186.48	-287,868.52 0.09
XS2746647036CESK SP 4.824 01-30	(366)	150130	12,000,000.	M EUR	101.5266	% 28/06/24	101.583	4	12,183,197.74	12,457,257.05	267,297.05	274,059.31 0.43
XS2676413235CESK SP 5.737 03-28	(366)	080328	4,700,000.	M EUR	101.1903	% 28/06/24	103.3235	4	4,755,944.81	4,941,897.99	85,693.49	185,953.18 0.17
XS2830463118CITY OY 7.875 PERP	(366)	311299	1,900,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	77.98	4	1,900,000.00	1,490,613.85	8,993.85	-409,386.15 0.05
DE000CZ45W81CMZB FR 6.5 12-32	(366)	061232	5,800,000.	M EUR	99.778	% 28/06/24	105.611	4	5,787,124.00	6,340,719.42	215,281.42	553,595.42 0.22
XS2202900424COOP RA 4.375 PERP	(UST)	311299	5,000,000.	M EUR	96.3207	% 28/06/24	95.1605	4	4,816,033.65	4,759,818.03	1,793.03	-56,215.62 0.16
XS2456432413COOP RA 4.875 PERP	(UST)	311299	4,200,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	93.787	4	4,200,000.00	3,940,732.28	1,678.28	-259,267.72 0.14
XS2412556461CRED EM 1.125 01-28	(366)	190128	11,000,000.	M EUR	99.995	% 28/06/24	93.537	4	10,999,450.00	10,344,858.93	55,788.93	-654,591.07 0.36
FR0013299468CRED LO 1.35 11-29	(366)	281129	7,800,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	98.581	4	7,800,000.00	7,751,749.97	62,431.97	-48,250.03 0.27
FR0013291556CRED MU 1.875 10-29	(366)	251029	5,000,000.	M EUR	97.5015	% 28/06/24	99.129	4	4,875,073.66	5,020,743.03	64,293.03	145,669.37 0.17
BE0002989706CRELAN 5.25 01-32	(366)	230132	3,500,000.	M EUR	106.3402	% 28/06/24	104.4625	4	3,721,905.74	3,737,017.42	80,829.92	15,111.68 0.13
BE0002936178CRELAN 6.0 02-30	(366)	280230	9,700,000.	M EUR	108.4217	% 28/06/24	106.389	4	10,516,905.57	10,518,503.49	198,770.49	1,597.92 0.36
DE000A30VT97DEUT BK 10.0 PERP	(366)	311299	2,000,000.	M EUR	100.39	% 28/06/24	107.745	4	2,007,800.00	2,189,420.55	34,520.55	181,620.55 0.08
DE000DL19WN3DEUT BK 4.0 06-32	(366)	240632	9,000,000.	M EUR	99.7113	% 28/06/24	97.6065	4	8,974,015.60	8,792,475.41	7,890.41	-181,540.19 0.30
DE000DL19VBODEUT BK 5.625 05-31	(366)	190531	5,000,000.	M EUR	106.2408	% 28/06/24	101.381	4	5,312,038.93	5,102,954.11	33,904.11	-209,084.82 0.18
DE000DL19WG7DEUT BK 6.75 PERP	(366)	311299	2,600,000.	M EUR	100.014	% 28/06/24	96.3245	4	2,600,364.00	2,534,728.78	30,291.78	-65,635.22 0.09
XS1637926137DEUT PFAN FLR 06-27	(366)	280627	15,100,000.	M EUR	75.5907	% 28/06/24	73.925	4	11,414,198.75	11,170,417.78	7,742.78	-243,780.97 0.39
FR0013367612EDF 4.0 PERP	(366)	311299	5,000,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	99.9865	4	5,000,000.00	5,147,958.88	148,633.88	147,958.88 0.18
XS2381272207ENBW EN 1.375 08-81	(366)	310881	4,000,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	87.7205	4	4,000,000.00	3,554,803.61	45,983.61	-445,196.39 0.12
XS2242929532ENI 2.625 PERP	(366)	311299	5,000,000.	M EUR	99.403	% 28/06/24	97.3295	4	4,970,150.00	4,927,796.72	61,321.72	-42,353.28 0.17
AT0000A2RZL4ERST BA 0.75 07-28	(366)	060728	19,400,000.	M EUR	99.505	% 28/06/24	89.8165	4	19,303,970.00	17,568,310.84	143,909.84	-1,735,659.16 0.61
AT0000A3CTX2ERST GR 7.0 PERP	(UST)	311299	21,000,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	98.319	4	21,000,000.00	20,843,793.28	196,803.28	-156,206.72 0.72
FR001400PT46GROU DE 5.0 10-44	(366)	301044	10,100,000.	M EUR	99.614	% 28/06/24	98.5045	4	10,061,014.00	10,035,880.73	86,926.23	-25,133.27 0.35
SE0016278352HEIM AB 6.75 PERP	(EUR)	311299	4,700,000.	M EUR	99.8569	% 28/06/24	35.8975	4	4,693,275.00	1,834,351.25	147,168.75	-2,858,923.75 0.06
XS2486589596HSBC 3.019 06-27	(366)	150627	8,000,000.	M EUR	97.15	% 28/06/24	98.5485	4	7,772,000.00	7,895,128.88	11,248.88	123,128.88 0.27
ES0344251022IBER 4.375 07-28	(366)	310728	5,900,000.	M EUR	99.861	% 28/06/24	101.001	4	5,891,799.00	6,067,668.97	108,609.97	175,869.97 0.21
DE000A2GSG24IKB DEUT I FLR 01-28	(366)	310128	4,900,000.	M EUR	85.8101	% 28/06/24	93.9195	4	4,204,694.02	4,735,977.32	133,921.82	531,283.30 0.16
XS2443920249ING GRO 1.25 02-27	(366)	160227	2,000,000.	M EUR	92.7075	% 28/06/24	96.1215	4	1,854,150.68	1,931,787.92	9,357.92	77,637.24 0.07
XS2586873379JULI BA 6.625 PERP	(UST)	311299	5,000,000.	M EUR	96.1976	% 28/06/24	97.273	4	4,809,882.47	4,989,233.79	125,583.79	179,351.32 0.17
BE0002592708KBC GRO 4.25 PERP	(UST)	311299	12,800,000.	M EUR	98.052	% 28/06/24	97.1495	4	12,550,656.31	12,537,693.38	102,557.38	-12,962.93 0.43
FR0012206217MACIF FIX 061049	(366)	311299	500,000.	M EUR	100.863	% 28/06/24	99.2595	E	504,315.00	510,741.76	14,444.26	6,426.76 0.02
ES0224244089MAPF SA 4.375 03-47	(366)	310347	5,000,000.	M EUR	109.0893	% 28/06/24	99.7465	4	5,454,465.75	5,043,061.30	55,736.30	-411,404.45 0.17
XS2388876232MBANK 0.966 09-27	(366)	210927	4,100,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	91.1365	4	4,100,000.00	3,767,437.24	30,840.74	-332,562.76 0.13
XS2386287689MEDI CR 0.75 11-28	(366)	021128	9,400,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	90.8305	4	9,400,000.00	8,584,874.38	46,807.38	-815,125.62 0.30
XS2221845683MUNI RE 1.25 05-41	(366)	270541	3,000,000.	M EUR	98.847	% 28/06/24	83.6285	4	2,965,410.00	2,512,656.37	3,801.37	-452,753.63 0.09
ES0865936027NCG BAN 10.625 PERP	(UST)	311299	12,800,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	111.424	4	12,800,000.00	14,557,436.84	295,164.84	1,757,436.84 0.50
ES0265936031NCG BAN 5.25 09-28	(366)	140928	6,400,000.	M EUR	99.721	% 28/06/24	103.8055	4	6,382,144.00	6,911,617.57	268,065.57	529,473.57 0.24
ES0365936048NCG BAN 5.5 05-26	(366)	180526	15,000,000.	M EUR	99.8384	% 28/06/24	101.2595	4	14,975,760.00	15,290,637.33	101,712.33	314,877.33 0.53
XS1691468026NIBC BA 6.0 PERP	(UST)	311299	4,200,000.	M EUR	95.2894	% 28/06/24	100.1095	4	4,002,155.74	4,258,303.92	53,704.92	256,148.18 0.15
XS2825500593NORD LA 5.625 08-34	(366)	230834	25,000,000.	M EUR	100.0434	% 28/06/24	99.3195	E	25,010,846.00	24,983,563.52	153,688.52	-27,282.48 0.86
PTNOBLOM0006NOVO BA 4.25 03-28	(366)	080328	10,600,000.	M EUR	99.782	% 28/06/24	100.0975	4	10,576,892.00	10,753,507.60	143,172.60	176,615.60 0.37
PTNOBLOM0001NOVO BA 9.875 12-33	(366)	011233	14,000,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	115.909	4	14,000,000.00	17,035,606.99	808,346.99	3,035,606.99 0.59
XS2498964209Nova Lj 6.0 07-25	(366)	190725	7,800,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	100.1105	4	7,800,000.00	8,254,881.30	446,262.30	454,881.30 0.29

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/24

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 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	
XS2754491640	OTP BAN 5.0 01-29	(366) 310129	26,200,000.	M EUR	99.915	% 28/06/24	100.4575	4	26,177,730.00	26,867,487.95	547,622.95	689,757.95	0.93
XS2611221032	PERM TS 6.625 04-28	(366) 250428	2,000,000.	M EUR	104.1468	% 28/06/24	105.3955	4	2,082,935.85	2,132,594.93	24,684.93	49,659.08	0.07
XS2641927574	PERM TS 6.625 06-29	(366) 300629	1,000,000.	M EUR	113.6549	% 28/06/24	107.6275	4	1,136,548.91	1,076,638.01	363.01	-59,910.90	0.04
XS2582358789	PKO BAN 5.625 02-26	(366) 010226	11,200,000.	M EUR	99.9214	% 28/06/24	100.7745	4	11,191,200.00	11,548,383.34	261,639.34	357,183.34	0.40
XS2113662063	POSAV 5.375 PERP	(366) 311299	791,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	98.047	4	791,000.00	792,627.97	17,076.20	1,627.97	0.03
ATO000A39724	POSAV 9.5 PERP	(366) 311299	17,000,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	107.94	E	17,000,000.00	18,998,447.54	648,647.54	1,998,447.54	0.66
XS2049823763	RAIF BA 1.5 03-30	(366) 120330	5,000,000.	M EUR	88.0877	% 28/06/24	96.2315	4	4,404,383.56	4,834,588.70	23,013.70	430,205.14	0.17
XS2765027193	RAIF BA 4.625 08-29	(366) 210829	2,200,000.	M EUR	99.748	% 28/06/24	99.7225	E	2,194,456.00	2,230,591.72	36,696.72	36,135.72	0.08
XS2534786590	RAIF BA 7.375 12-32	(366) 201232	3,700,000.	M EUR	99.48	% 28/06/24	104.432	4	3,680,760.00	4,009,368.22	145,384.22	328,608.22	0.14
FR0014002QE8	SG 1.125 06-31	(366) 300631	5,300,000.	M EUR	99.395	% 28/06/24	93.4525	4	5,267,935.00	4,953,309.21	326.71	-314,625.79	0.17
FR00140000Z2	SOCIETE GENERALE	(366) 241130	5,000,000.	M EUR	99.6786	% 28/06/24	95.3585	4	4,983,931.51	4,798,116.26	30,191.26	-185,815.25	0.17
FR001400M1X9	SOGE 6.5 05-44	(366) 160544	9,600,000.	M EUR	99.664	% 28/06/24	106.808	E	9,567,744.00	10,333,918.68	80,350.68	766,174.68	0.36
BE6324000858	SYEN SA 2.5 PERP	(366) 311299	10,000,000.	M EUR	96.6418	% 28/06/24	96.588	4	9,664,178.63	9,742,361.64	83,561.64	78,183.01	0.34
XS2432130610	TOTA SE 2.0 PERP	(366) 311299	4,250,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	93.6485	4	4,250,000.00	3,997,759.88	17,698.63	-252,240.12	0.14
FR001400IU83	UNIB RO 7.25 PERP	(366) 311299	14,500,000.	M EUR	93.9824	% 28/06/24	105.117	4	13,627,452.19	16,026,094.10	784,129.10	2,398,641.91	0.55
XS2021993212	UNIC 1.625 07-25	(366) 030725	8,000,000.	M EUR	104.8235	% 28/06/24	99.9935	4	8,385,879.45	8,129,124.81	129,644.81	-256,754.64	0.28
XS2101558307	UNIC 2.731 01-32	(366) 150132	5,400,000.	M EUR	91.0779	% 28/06/24	95.3745	4	4,918,206.67	5,218,318.92	68,095.92	300,112.25	0.18
XS1739839998	UNIC 5.375 PERP	(UST) 311299	2,000,000.	M EUR	84.7773	% 28/06/24	99.261	4	1,695,546.45	1,993,737.76	8,517.76	298,191.31	0.07
XS2555420103	UNIC 5.85 11-27	(366) 151127	2,850,000.	M EUR	99.948	% 28/06/24	104.425	4	2,848,518.00	3,080,885.04	104,772.54	232,367.04	0.11
XS1117293107	UNIQ VER 6.0 07-46	(366) 270746	200,000.	M EUR	100.0984	% 28/06/24	103.0285	4	200,196.72	217,237.33	11,180.33	17,040.61	0.01
XS2746119952	VAN LAN 8.875 PERP	(EUR) 311299	9,600,000.	M EUR	102.3064	% 28/06/24	107.842	4	9,821,416.67	10,568,198.67	215,366.67	746,782.00	0.37
XS2378468420	WUES WU 2.125 09-41	(366) 100941	10,100,000.	M EUR	99.1285	% 28/06/24	79.7665	4	10,011,980.53	8,229,993.00	173,576.50	-1,781,987.53	0.28
CH1170565753	ZUER KA 2.02 04-28	(366) 130428	8,400,000.	M EUR	100.	% 28/06/24	95.399	4	8,400,000.00	8,050,706.14	37,190.14	-349,293.86	0.28
XS2189970317	ZURI FI 1.875 09-50	(366) 170950	5,000,000.	M EUR	99.699	% 28/06/24	87.675	4	4,984,950.00	4,457,776.64	74,026.64	-527,173.36	0.15

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CUMUL (EUR)

857,449,485.19 871,027,190.18 16,986,543.91 13,577,704.99 30.09

AUTRES OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES NEGOCIEES SUR UN MARCHE REGLEMENTE

CUMUL (EUR)

2,849,224,696.86 2,873,617,877.23 42,415,266.89 24,393,180.37 99.28

I-OBLIGATIONS & VALEURS ASSIMILEES

CUMUL (EUR)

2,849,224,696.86 2,873,617,877.23 42,415,266.89 24,393,180.37 99.28

III - TITRES D OPC

OPCVM ET EQUIVALENTS D AUTRES ETATS MEMBRE DE L UE

DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE

FR0014009K66	R-CO VAL BD OPP P CH		1,000.	P CHF	100.	M 27/06/24	106.92	5	101,122.46	110,981.94	0.00	9,859.48	0.00
FR001400IBL7	RCO TARGET27 ICHFH		2,000.	P CHF	1000.	M 27/06/24	1055.85	5	2,091,612.63	2,191,924.43	0.00	100,311.80	0.08

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE

CUMUL (EUR)

2,192,735.09 2,302,906.37 0.00 110,171.28 0.08

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FR0007393285	R-CO 4CHANGE NETZ C		100,480.7026	P EUR	36.231	M 27/06/24	38.77	5	3,640,519.50	3,895,636.84	0.00	255,117.34	0.13
FR0011716398	R-CO CO HI YI IC EUR		908.	P EUR	1325.23	M 27/06/24	1325.35	5	1,203,308.84	1,203,417.80	0.00	108.96	0.04
FR00140060V1	R-CO CONV SUBFIN ID		2,000.	P EUR	1000.	M 27/06/24	927.29	5	2,000,000.00	1,854,580.00	0.00	-145,420.00	0.06
FR00140060X7	R-CO CONV SUBFIN I		3,665.	P EUR	1000.	M 27/06/24	986.73	5	3,665,000.00	3,616,365.45	0.00	-48,634.55	0.12
FR00140060Y5	R-CO CONV SUBFIN C		1,000.	P EUR	100.	M 27/06/24	97.55	5	100,000.00	97,550.00	0.00	-2,450.00	0.00

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/24

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 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	Devise du portefeuille					PRCT ACT NET
								<-----> PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL		
FR001400LS82 RCO TGT 29 IG P2 EUR		1,000.	P EUR	100.	M 27/06/24	101.85	5	100,000.00	101,850.00	0.00	1,850.00	0.00	
FR001400LSA8 RCO TGT 29 IG IC2 EU		2,000.	P EUR	1000.	M 27/06/24	1023.05	5	2,000,000.00	2,046,100.00	0.00	46,100.00	0.07	
FR0007442496 RMM COURT TERME C		7,208.	P EUR	4117.3715	M 27/06/24	4118.93	5	29,678,014.07	29,689,247.44	0.00	11,233.37	1.03	
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO													
								CUMUL (EUR)	42,386,842.41	42,504,747.53	0.00	117,905.12	1.47

VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHES A TERME

ENGAGEMENTS A TERME FERMES

FUTURES SUR OBLIGATIONS

SOUS-JACENT : EUXOE EUREX BOBL EURO

FBOL0000013Y EURO BOBL 0924		1,058.	EUR	116.0505	M 28/06/24	116.44	4	0.00	412,040.00	0.00	412,040.00	0.01
-----------------------------	--	--------	-----	----------	------------	--------	---	------	------------	------	------------	------

VII - AUTRES ENGAGEMENTS

DERIVES DE CREDIT

CREDIT DEFAULT SWAP (CDS)

DATE ECHEANCE : 20/12/25

CDS028984503 ALSTOM 3.0 07-19_201	APROT 20/12/25	-6,500,000.	EUR	-0.898	% 28/06/24	-0.78012	H	58,366.97	-52,332.80	-1,625.00	-110,699.77	0.00
-----------------------------------	----------------	-------------	-----	--------	------------	----------	---	-----------	------------	-----------	-------------	------

DATE ECHEANCE : 20/12/26

CDS028985003 ALSTOM 3.0 07-19_201	APROT 20/12/26	-6,500,000.	EUR	-1.8064	% 28/06/24	-0.83277	H	117,418.81	-55,755.05	-1,625.00	-173,173.86	0.00
-----------------------------------	----------------	-------------	-----	---------	------------	----------	---	------------	------------	-----------	-------------	------

DATE ECHEANCE : 20/06/29

CDS029270303 ITRAXX EUROPE S41 V1	APROT 20/06/29	-608,000,000.	EUR	1.8984	% 28/06/24	-1.78122	H	-11,542,192.96	-10,981,817.60	-152,000.00	560,375.36	-0.38
-----------------------------------	----------------	---------------	-----	--------	------------	----------	---	----------------	----------------	-------------	------------	-------

CREDIT DEFAULT SWAP (CDS)

CUMUL (EUR)

-11,366,407.18

-11,089,905.45

-155,250.00

276,501.73

-0.38

IX - TRESORERIE

DETTES ET CREANCES

REGLEMENTS DIFFERES

DEVISE VALEUR : EUR EURO

ARDEUR Ach rgl t di fféré		-29,404,294.45	EUR	1.	28/06/24	1.		-29,404,294.45	-29,404,294.45	0.00	0.00	-1.02
---------------------------	--	----------------	-----	----	----------	----	--	----------------	----------------	------	------	-------

COUPONS ET DIVIDENDES EN ESPECES

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FR0013346814 ALTA 2.875 07-25		93.	P EUR	2875.	28/06/24		A	267,375.00	267,375.00	0.00	0.00	0.01
FR0013430840 UMG GRO 1.625 07-29		80.	P EUR	1625.	28/06/24		A	130,000.00	130,000.00	0.00	0.00	0.00
FR0014002QE8 SG 1.125 06-31		53.	P EUR	1125.	28/06/24		A	59,625.00	59,625.00	0.00	0.00	0.00
XS1637926137 DEUT PFAN FLR 06-27		151.	P EUR	4679.	28/06/24		A	706,529.00	706,529.00	0.00	0.00	0.02
XS2202900424 COOP RA 4.375 PERP		25.	P EUR	4375.	28/06/24		A	109,375.00	109,375.00	0.00	0.00	0.00
XS2456432413 COOP RA 4.875 PERP		21.	P EUR	4875.	28/06/24		A	102,375.00	102,375.00	0.00	0.00	0.00
XS2641927574 PERM TS 6.625 06-29		1,000.	P EUR	66.25	28/06/24		A	66,250.00	66,250.00	0.00	0.00	0.00

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CUMUL (EUR)

1,441,529.00

1,441,529.00

0.00

0.00

0.05

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/24

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 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	Devise du portefeuille				PRCT ACT NET	
								<-----> PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL		
APPELS DE MARGE													
DEVISE VALEUR : EUR EURO													
MARRCEUR	Appel Marge R.M.M.	-412,040.	EUR	1.	28/06/24	1.		-412,040.00	-412,040.00	0.00	0.00	-0.01	
FRAIS DE GESTION													
DEVISE VALEUR : EUR EURO													
FGPVFC1EUR	Frais de Gest. Fixe	-399,143.03	EUR	1.	28/06/24	1.		-399,143.03	-399,143.03	0.00	0.00	-0.01	
FGPVFC2EUR	Frais de Gest. Fixe	-54,608.81	EUR	1.	28/06/24	1.		-54,608.81	-54,608.81	0.00	0.00	0.00	
FGPVFC3EUR	Frais de Gest. Fixe	-286,566.49	EUR	1.	28/06/24	1.		-286,566.49	-286,566.49	0.00	0.00	-0.01	
FGPVFC4EUR	Frais de Gest. Fixe	-5.65	EUR	1.	28/06/24	1.		-5.65	-5.65	0.00	0.00	0.00	
FGPVFC5EUR	Frais de Gest. Fixe	-444.54	EUR	1.	28/06/24	1.		-444.54	-444.54	0.00	0.00	0.00	
FGPVFC6EUR	Frais de Gest. Fixe	-6,731.14	EUR	1.	28/06/24	1.		-6,731.14	-6,731.14	0.00	0.00	0.00	
FGPVFC7EUR	Frais de Gest. Fixe	-1.44	EUR	1.	28/06/24	1.		-1.44	-1.44	0.00	0.00	0.00	
FGPVFC8EUR	Frais de Gest. Fixe	-129,231.17	EUR	1.	28/06/24	1.		-129,231.17	-129,231.17	0.00	0.00	0.00	
FGPVFC9EUR	Frais de Gest. Fixe	-409.96	EUR	1.	28/06/24	1.		-409.96	-409.96	0.00	0.00	0.00	
FGPVFCAEUR	Frais de Gest. Fixe	-7,134.43	EUR	1.	28/06/24	1.		-7,134.43	-7,134.43	0.00	0.00	0.00	
FGPVFCBEUR	Frais de Gest. Fixe	-11,636.73	EUR	1.	28/06/24	1.		-11,636.73	-11,636.73	0.00	0.00	0.00	
FGPVFCCEUR	Frais de Gest. Fixe	-62,537.04	EUR	1.	28/06/24	1.		-62,537.04	-62,537.04	0.00	0.00	0.00	
FGPVFD1EUR	Frais de Gest. Fixe	-3,770.37	EUR	1.	28/06/24	1.		-3,770.37	-3,770.37	0.00	0.00	0.00	
FGPVFD2EUR	Frais de Gest. Fixe	-10,756.91	EUR	1.	28/06/24	1.		-10,756.91	-10,756.91	0.00	0.00	0.00	
FGPVFD3EUR	Frais de Gest. Fixe	-27,943.14	EUR	1.	28/06/24	1.		-27,943.14	-27,943.14	0.00	0.00	0.00	
FGPVFD4EUR	Frais de Gest. Fixe	-17,204.65	EUR	1.	28/06/24	1.		-17,204.65	-17,204.65	0.00	0.00	0.00	
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO								CUMUL (EUR)	-1,018,125.50	-1,018,125.50	0.00	0.00	-0.04
DETTES ET CREANCES													
								CUMUL (EUR)	-29,392,930.95	-29,392,930.95	0.00	0.00	-1.02
DISPONIBILITES													
AVOIRS													
DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE													
BQRCCHF	ROTHSCHI LD MM	907,641.09	CHF	1.04848574	28/06/24	1.03799045		951,648.74	942,122.78	0.00	-9,525.96	0.03	
DEVISE VALEUR : EUR EURO													
BQRCEUR	ROTHSCHI LD MM	12,403,582.71	EUR	1.	28/06/24	1.		12,403,582.71	12,403,582.71	0.00	0.00	0.43	
DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING													
BQRCGBP	ROTHSCHI LD MM	550,564.21	GBP	1.18661275	28/06/24	1.1815024		653,306.51	650,492.93	0.00	-2,813.58	0.02	
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US													
BQRUSD	ROTHSCHI LD MM	34,538.15	USD	0.93554142	28/06/24	0.93414292		32,311.87	32,263.57	0.00	-48.30	0.00	

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/24

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

V A L E U R	STATUTS	DOSSIER	QUANTITE ET	DEV	P.R.U EN DEVISE	DATE	COURS	I	<----->	Devise du portefeuille			>----->	PRCT	
	VAL/LIGNE		EXPR. QUANTITE	COT	ET EXPR. COURS	COTA	VALEUR	F	PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	ACT NET		
AVOIRS															
										CUMUL (EUR)	14,040,849.83	14,028,461.99	0.00	-12,387.84	0.48
CHANGE A TERME ET SWAP DE CHANGE															
<i>DATE ECHEANCE : 13/09/24</i>															
24164002112	A USD EUR	13/09/24	847,471.	USD	0.9263	28/06/24	0.93086457		785,018.83	788,880.73	0.00	3,861.90	0.03		
	VERSE	13/09/24	-785,018.83	EUR	1.	28/06/24	1.		-785,018.83	-785,018.83	0.00	0.00	-0.03		
24164002113	A USD EUR	13/09/24	22,337,300.	USD	0.9263	28/06/24	0.93086457		20,691,210.73	20,793,001.09	0.00	101,790.36	0.72		
	VERSE	13/09/24	-20,691,210.73	EUR	1.	28/06/24	1.		-20,691,210.73	-20,691,210.73	0.00	0.00	-0.71		
24164002240	A CHF EUR	13/09/24	10,000.	CHF	1.0438	28/06/24	1.04330231		10,437.92	10,433.02	0.00	-4.90	0.00		
	VERSE	13/09/24	-10,437.92	EUR	1.	28/06/24	1.		-10,437.92	-10,437.92	0.00	0.00	0.00		
24164002241	A CHF EUR	13/09/24	23,797,300.	CHF	1.0438	28/06/24	1.04330231		24,839,438.65	24,827,778.10	0.00	-11,660.55	0.86		
	VERSE	13/09/24	-24,839,438.65	EUR	1.	28/06/24	1.		-24,839,438.65	-24,839,438.65	0.00	0.00	-0.86		
24164002242	A CHF EUR	13/09/24	1,121,861.	CHF	1.0438	28/06/24	1.04330231		1,170,989.88	1,170,440.17	0.00	-549.71	0.04		
	VERSE	13/09/24	-1,170,989.88	EUR	1.	28/06/24	1.		-1,170,989.88	-1,170,989.88	0.00	0.00	-0.04		
24164002748	V GBP EUR	13/09/24	6,850,666.11	EUR	1.	28/06/24	1.		6,850,666.11	6,850,666.11	0.00	0.00	0.24		
	VERSE	13/09/24	-5,800,000.	GBP	1.1811	28/06/24	1.17784677		-6,850,666.11	-6,831,511.28	0.00	19,154.83	-0.24		
24169003716	A USD EUR	13/09/24	19,000.	USD	0.9288	28/06/24	0.93086338		17,647.71	17,686.40	0.00	38.69	0.00		
	VERSE	13/09/24	-17,647.71	EUR	1.	28/06/24	1.		-17,647.71	-17,647.71	0.00	0.00	0.00		
24172002757	A CHF EUR	13/09/24	485,000.	CHF	1.0513	28/06/24	1.04351285		509,875.82	506,103.73	0.00	-3,772.09	0.02		
	VERSE	13/09/24	-509,875.82	EUR	1.	28/06/24	1.		-509,875.82	-509,875.82	0.00	0.00	-0.02		
24173002498	A USD EUR	13/09/24	63,000.	USD	0.932	28/06/24	0.93086796		58,718.43	58,644.68	0.00	-73.75	0.00		
	VERSE	13/09/24	-58,718.43	EUR	1.	28/06/24	1.		-58,718.43	-58,718.43	0.00	0.00	0.00		
SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 13/09/24										CUMUL (EUR)	0.00	108,784.78	0.00	108,784.78	
DISPONIBILITES															
										CUMUL (EUR)	14,040,849.83	14,137,246.77	0.00	96,396.94	0.49
IX - TRESORERIE															
										CUMUL (EUR)	-15,352,081.12	-15,255,684.18	0.00	96,396.94	-0.53
PORTEFEUILLE : R-CO CONVICTION CREDIT EURO (1109)															
										(EUR)	2,876,886,245.72	2,894,384,495.26	42,260,016.89	17,498,249.54	100.00

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/24

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

Portefeuille titres : 2,909,748,964.22 Coupons et dividendes a recevoir : 1,441,529.

Frais de gestion du jour

Frais de Gest. Fixe :	14,209.44	EUR
Frais de Gest. Fixe :	1,954.16	EUR
Frais de Gest. Fixe :	10,255.23	EUR
Frais de Gest. Fixe :	0.2	EUR
Frais de Gest. Fixe :	16.86	EUR
Frais de Gest. Fixe :	241.32	EUR
Frais de Gest. Fixe :	4,607.95	EUR
Frais de Gest. Fixe :	14.34	EUR
Frais de Gest. Fixe :	255.93	EUR
Frais de Gest. Fixe :	422.55	EUR
Frais de Gest. Fixe :	2,217.06	EUR
Frais de Gest. Fixe :	139.2	EUR
Frais de Gest. Fixe :	383.43	EUR
Frais de Gest. Fixe :	618.52	EUR
Frais de Gest. Fixe :	0.05	EUR
Frais de Gest. Fixe :	1,013.26	EUR

Frais de gestion charge Entreprise

Frais maximum notice :	1,013.26	EUR
FRAIS MAXIMUM :	14,209.44	EUR
FRAIS MAXIMUM :	1,954.16	EUR
FRAIS MAXIMUM :	10,255.23	EUR
FRAIS MAXIMUM :	0.2	EUR
FRAIS MAXIMUM :	16.86	EUR
FRAIS MAXIMUM :	241.32	EUR
FRAIS MAXIMUM :	0.05	EUR
FRAIS MAXIMUM :	4,607.95	EUR
FRAIS MAXIMUM :	14.34	EUR
FRAIS MAXIMUM :	255.93	EUR
FRAIS MAXIMUM :	422.55	EUR
Frais maximum notice :	2,217.06	EUR
FRAIS MAXIMUM :	139.2	EUR
FRAIS MAXIMUM :	383.43	EUR
FRAIS MAXIMUM :	618.52	EUR

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/24

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
C1 FR0007008750 R-CO CV CRED CEUR	EUR	732,472,641.28	1,603,443.7976	456.81	25.305966755864			465.95	456.81
C2 FR0010807107 R-CO CV CRED FEUR	EUR	79,467,103.56	523,719.7737	151.74	2.745498203442			154.77	151.74
C3 FR0010807123 R-CO CV CRED ICEUR	EUR	1,072,393,931.45	736,208.3408	1,456.64	37.049436000687			1,456.64	1,456.64
C4 FR0011829068 R-CO CV CRED CCHF	EUR	10,446.74	10.0007	1,044.60	0.000362065112			1,065.49	1,044.60
C5 FR0011839877 R-CO CV CRED CUSD	EUR	869,075.56	728.1835	1,193.48	0.030049290891			1,217.35	1,193.48
C6 FR0011839885 R-CO CV CRED ICCHF	EUR	25,234,453.26	22,919.2094	1,101.02	0.874586567149			1,123.04	1,079.00
C7 FR0011839893 R-CO CV CRED MEUR	EUR	1,923,204.03	1,772.0538	1,085.30	0.066442883453			1,139.57	1,085.30
C8 FR0011839901 R-CO CV CRED PEUR	EUR	374,775,083.83	331,350.837	1,131.05	12.947894439026			1,153.67	1,131.05
C9 FR0011839919 R-CO CV CRED PCHF	EUR	1,166,108.22	1,063.0444	1,096.95	0.0404155616			1,118.89	1,096.95
CA FR0011839927 R-CO CV CRED PUSD	EUR	20,815,145.76	16,855.5104	1,234.92	0.719704535184			1,259.62	1,234.92
CB FR0013111804 R-CO CV CRED REUR	EUR	12,887,258.59	1,278,816.4504	10.08	0.445243802132			10.08	10.08
CC FR001400LJ67 R-CO CONVICT CRED SI	EUR	368,835,549.31	356,051.4643	1,035.91	12.742612710316			1,056.63	1,035.91
D1 FR0010134437 R-CO CV CRED DEUR	EUR	7,175,475.30	26,436.6781	271.42	0.247903237931			276.85	271.42
D2 FR0011418359 R-CO CV CRED IDEUR	EUR	40,095,807.71	414.3669	96,764.02	1.385243815758			98,699.30	96,764.02
D3 FR0012243988 R-CO CV CRED PBEUR	EUR	105,957,487.77	116,470.2926	909.74	3.660655890274			927.93	909.74
D4 FR0013294063 R-CO CV CRED MFEUR	EUR	50,305,722.89	54,985.8829	914.88	1.737984241181			933.18	914.88

Actif net total en EUR : 2,894,384,495.26

C4	CHF	10,064.39		1,006.37		0.9634		1,026.5	1,006.37
C6	CHF	24,310,872.27		1,060.72		0.9634		1,081.93	1,039.51
C9	CHF	1,123,428.66		1,056.8		0.9634		1,077.94	1,056.8
C5	USD	930,345.39		1,277.62		1.0705		1,303.17	1,277.62
CA	USD	22,282,613.54		1,321.98		1.0705		1,348.42	1,321.98

Precedente VL en date du 27/06/24 :

C1	R-CO CV CRED CEUR	Prec. VL :	457.24	(EUR)	Variation :	-0.094%
C2	R-CO CV CRED FEUR	Prec. VL :	151.88	(EUR)	Variation :	-0.092%
C3	R-CO CV CRED ICEUR	Prec. VL :	1,458.	(EUR)	Variation :	-0.093%
C4	R-CO CV CRED CCHF	Prec. VL :	1,048.9	(EUR)	Variation :	-0.410%
C5	R-CO CV CRED CUSD	Prec. VL :	1,195.56	(EUR)	Variation :	-0.174%
C6	R-CO CV CRED ICCHF	Prec. VL :	1,105.56	(EUR)	Variation :	-0.411%
C7	R-CO CV CRED MEUR	Prec. VL :	1,086.3	(EUR)	Variation :	-0.092%
C8	R-CO CV CRED PEUR	Prec. VL :	1,132.11	(EUR)	Variation :	-0.094%
C9	R-CO CV CRED PCHF	Prec. VL :	1,101.48	(EUR)	Variation :	-0.411%
CA	R-CO CV CRED PUSD	Prec. VL :	1,237.06	(EUR)	Variation :	-0.173%
CB	R-CO CV CRED REUR	Prec. VL :	10.09	(EUR)	Variation :	-0.099%
CC	R-CO CONVICT CRED SI	Prec. VL :	1,036.87	(EUR)	Variation :	-0.093%
D1	R-CO CV CRED DEUR	Prec. VL :	271.68	(EUR)	Variation :	-0.096%
D2	R-CO CV CRED IDEUR	Prec. VL :	96,854.27	(EUR)	Variation :	-0.093%

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/24

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

D3	R-CO CV CRED PBEUR	Prec. VL :	910.59	(EUR)	Variation :	-0.093%
D4	R-CO CV CRED MFEUR	Prec. VL :	915.74	(EUR)	Variation :	-0.094%

VL theorique

Part	Devise	Actif theorique	Valeur liquidative theorique
C1 FR0007008750 R-CO CV CRED CEUR	EUR	732,472,641.28	456.81
C2 FR0010807107 R-CO CV CRED FEUR	EUR	79,467,103.56	151.74
C3 FR0010807123 R-CO CV CRED ICEUR	EUR	1,072,393,931.45	1,456.64
C4 FR0011829068 R-CO CV CRED CCHF	EUR	10,446.74	1,044.60
C5 FR0011839877 R-CO CV CRED CUSD	EUR	869,075.56	1,193.48
C6 FR0011839885 R-CO CV CRED ICCHF	EUR	25,234,453.26	1,101.02
C7 FR0011839893 R-CO CV CRED MEUR	EUR	1,923,204.03	1,085.30
C8 FR0011839901 R-CO CV CRED PEUR	EUR	374,775,083.83	1,131.05
C9 FR0011839919 R-CO CV CRED PCHF	EUR	1,166,108.22	1,096.95
CA FR0011839927 R-CO CV CRED PUSD	EUR	20,815,145.76	1,234.92
CB FR0013111804 R-CO CV CRED REUR	EUR	12,887,258.59	10.08
CC FR001400LJ67 R-CO CONVICT CRED SI	EUR	368,835,549.31	1,035.91
D1 FR0010134437 R-CO CV CRED DEUR	EUR	7,175,475.30	271.42
D2 FR0011418359 R-CO CV CRED IDEUR	EUR	40,095,807.71	96,764.02
D3 FR0012243988 R-CO CV CRED PBEUR	EUR	105,957,487.77	909.74
D4 FR0013294063 R-CO CV CRED MFEUR	EUR	50,305,722.89	914.88

Actif theorique total en EUR : 2,894,384,495.26 (Sens collecte : EQU)

C4	CHF	10,064.39	1,006.37
C6	CHF	24,310,872.27	1,060.72
C9	CHF	1,123,428.66	1,056.8
C5	USD	930,345.39	1,277.62
CA	USD	22,282,613.54	1,321.98

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

Type reporting : TIBR Revenu taxable pour residents Belges

Poids officiels et statuts en date du 01/05/24 :

Poids DD :	98.12	Statut DD :	I
Poids DI :	98.76	Statut DI :	M

Type reporting : TISF TIS France

Poids officiels et statuts en date du 28/06/24 :

Poids DD :	98.78	Statut DD :	I
Poids DI :	100.	Statut DI :	M

Poids non officiels en date du 28/06/24 :

Poids DD :	98.78
Poids DI :	100.

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/24

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : PC23 TRI AMF/TYPE INSTRUMENT/ORDRE ALPHABETIQUE , Tris : BVAL04)

COURS DES DEVICES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente		variation	
Cours CHF en EUR :	1.0379904505	cotation :	28/06/24	0.	1.0412328197	cotation :	27/06/24	-0.3114
Cours EUR en CHF :	0.9634	cotation :	28/06/24	0.	0.9604	cotation :	27/06/24	0.31237
Cours EUR en EUR :	1.	cotation :	28/06/24	0.	1.	cotation :	27/06/24	0.
Cours EUR en GBP :	0.84638	cotation :	28/06/24	0.	0.8459	cotation :	27/06/24	0.05674
Cours EUR en USD :	1.0705	cotation :	28/06/24	0.	1.0696	cotation :	27/06/24	0.08414
Cours GBP en EUR :	1.1815023984	cotation :	28/06/24	0.	1.1821728337	cotation :	27/06/24	-0.05671
Cours USD en EUR :	0.9341429239	cotation :	28/06/24	0.	0.9349289454	cotation :	27/06/24	-0.08407

COURS INVERSES DES DEVICES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente		
Cours EUR en CHF :	0.9633999999	cotation :	28/06/24	0.	0.9603999999	cotation :	27/06/24
Cours CHF en EUR :	1.0379904504	cotation :	28/06/24	0.	1.0412328196	cotation :	27/06/24
Cours EUR en EUR :	1.	cotation :	28/06/24	0.	1.	cotation :	27/06/24
Cours GBP en EUR :	1.1815023984	cotation :	28/06/24	0.	1.1821728336	cotation :	27/06/24
Cours USD en EUR :	0.9341429238	cotation :	28/06/24	0.	0.9349289454	cotation :	27/06/24
Cours EUR en GBP :	0.84638	cotation :	28/06/24	0.	0.8458999999	cotation :	27/06/24
Cours EUR en USD :	1.0704999999	cotation :	28/06/24	0.	1.0696	cotation :	27/06/24

R-CO CONVICTION CREDIT EURO

DOCUMENT D'INFORMATION PÉRIODIQUE
28/06/2024

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	2 875 510 390,99
b) Avoirs bancaires	14 028 461,99
c) Autres actifs détenus par l'OPC	46 786 068,68
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	2 936 324 921,66
e) Passif	-41 940 426,40
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	2 894 384 495,26

(*) Les montants sont signés

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

Action	Type d'action	Actif net de l'action	Nombre d'actions en circulation	Valeur nette d'inventaire par action
R-CO CONVICTION CREDIT EURO C CHF H en CHF	C	10 064,39	10,0007	1 006,37
R-CO CONVICTION CREDIT EURO C EUR en EUR	C	732 472 641,28	1 603 443,7976	456,81
R-CO CONVICTION CREDIT EURO C USD H en USD	C	930 345,39	728,1835	1 277,62
R-CO CONVICTION CREDIT EURO D EUR en EUR	D	7 175 475,30	26 436,6781	271,42
R-CO CONVICTION CREDIT EURO F EUR en EUR	C	79 467 103,56	523 719,7737	151,74
R-CO CONVICTION CREDIT EURO IC CHF H en CHF	C	24 310 872,27	22 919,2094	1 060,72
R-CO CONVICTION CREDIT EURO IC EUR en EUR	C	1 072 393 931,45	736 208,3408	1 456,64
R-CO CONVICTION CREDIT EURO ID EUR en EUR	D	40 095 807,71	414,3669	96 764,02
R-CO CONVICTION CREDIT EURO M EUR en EUR	C	1 923 204,03	1 772,0538	1 085,30
R-CO CONVICTION CREDIT EURO MF EUR en EUR	D	50 305 722,89	54 985,8829	914,88
R-CO CONVICTION CREDIT EURO PB EUR en EUR	D	105 957 487,77	116 470,2926	909,74
R-CO CONVICTION CREDIT EURO P CHF H en CHF	C	1 123 428,66	1 063,0444	1 056,80
R-CO CONVICTION CREDIT EURO P EUR en EUR	C	374 775 083,83	331 350,8370	1 131,05
R-CO CONVICTION CREDIT EURO P USD H en USD	C	22 282 613,54	16 855,5104	1 321,98
R-CO CONVICTION CREDIT EURO R EUR en EUR	C	12 887 258,59	1 278 816,4504	10,08
R-CO CONVICTION CREDIT EURO SI EUR en EUR	C	368 835 549,31	356 051,4643	1 035,91

ELEMENT 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.	86,89	85,65
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.	12,46	12,28
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.	1,55	1,53

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

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

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

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
Euro	EUR	2 858 953 912,78	98,78	97,37
Dollar Us	USD	16 556 478,21	0,57	0,56
TOTAL		2 875 510 390,99	99,35	97,93

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

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

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RESIDENCE DE L'EMETTEUR

Pays	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
FRANCE	19,92	19,63
ALLEMAGNE	13,72	13,53
PAYS-BAS	9,50	9,36
ESPAGNE	7,32	7,21
ITALIE	7,07	6,97
LUXEMBOURG	5,19	5,12
BELGIQUE	4,37	4,31
IRLANDE	3,85	3,79
ROYAUME-UNI	3,43	3,38
AUSTRALIE	3,40	3,35
PORTUGAL	3,32	3,28
ETATS-UNIS	3,09	3,04
AUTRICHE	3,09	3,04
NORVEGE	2,69	2,66
DANEMARK	1,96	1,93
POLOGNE	1,60	1,58
SUEDE	1,51	1,49
HONGRIE	0,93	0,92
FINLANDE	0,89	0,88
MEXIQUE	0,85	0,84
REPUBLIQUE TCHEQUE	0,60	0,59
SUISSE	0,45	0,44
SLOVENIE	0,29	0,28
JERSEY	0,17	0,17
CANADA	0,14	0,14
TOTAL	99,35	97,93

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

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

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

Nature d'actifs	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	1,55	1,53
Autres OPC et fonds d'investissements	0,00	0,00
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	0,00	0,00
Autres	0,00	0,00
TOTAL	1,55	1,53

(*) 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 PERIODE 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.	988 179 134,45	772 102 077,07
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.	155 708 060,18	75 949 148,36
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.	662 668 618,63	639 191 598,93

DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE

	Action	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
Dividendes versés				
24/05/2024	R-CO CONVICTION CREDIT EURO D EUR	4,62	0,00	4,62
24/05/2024	R-CO CONVICTION CREDIT EURO ID EUR	1 943,20	0,00	1 943,20
24/05/2024	R-CO CONVICTION CREDIT EURO MF EUR	17,40	0,00	17,40
24/05/2024	R-CO CONVICTION CREDIT EURO PB EUR	17,31	0,00	17,31
Dividendes à verser				
	R-CO CONVICTION CREDIT EURO D EUR			
	R-CO CONVICTION CREDIT EURO ID EUR			
	R-CO CONVICTION CREDIT EURO MF EUR			
	R-CO CONVICTION CREDIT EURO PB EUR			

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ACTIONS ET VALEURS ASSIMILÉES			1 892 513,76	0,07
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			1 892 513,76	0,07
Construction et ingénierie			0,00	0,00
ABENGOA SA- B SHARES	EUR	12 706 492	0,00	0,00
ABENGOA SA -CL A	EUR	1 228 837	0,00	0,00
Soins et autres services médicaux			1 892 513,76	0,07
EMEIS	EUR	164 767	1 892 513,76	0,07
Actions et valeurs assimilées non négociées sur un marché réglementé ou assimilé			0,00	0,00
Construction et ingénierie			0,00	0,00
SFP 2020 CMC DI RAVENNA	EUR	1 342 565	0,00	0,00
OBLIGATIONS CONVERTIBLES EN ACTIONS			0,00	0,00
Obligations convertibles négociées sur un marché réglementé ou assimilé			0,00	0,00
Equipement et services pour l'énergie			0,00	0,00
ABENGOA ABENEWCO 2 SAU 1.5% 26-10-24	EUR	4 738 730	0,00	0,00
ABENGOA ABENEWCO 2 SAU 1.5% 26-10-24 DEFAULT	EUR	4 738 730	0,00	0,00
OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES			2 873 617 877,23	99,28
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			2 873 617 877,23	99,28
Assurance			138 507 565,85	4,79
ACHMEA BV 4.625% PERP	EUR	5 800 000	5 314 731,02	0,18
AGEAS NV EX FORTIS 1.875% 24-11-51	EUR	6 200 000	5 193 161,67	0,18
AGEAS NV EX FORTIS 3.875% PERP	EUR	8 000 000	6 831 364,93	0,24
ALLIANZ SE 2.6% PERP	EUR	7 000 000	5 319 598,70	0,18
APICIL PREVOYANCE 4.0% 24-10-29	EUR	7 900 000	7 663 797,77	0,26
ASR NEDERLAND NV 3.625% 12-12-28	EUR	5 100 000	5 205 803,96	0,18
ASR NEDERLAND NV 6.625% PERP	EUR	16 600 000	16 621 298,80	0,60
AXA 6.375% PERP EMTN	EUR	10 000 000	10 543 980,77	0,36
CASA ASSURANCES 2.0% 17-07-30	EUR	14 000 000	12 424 514,59	0,43
CCR RE 2.875% 15-07-40	EUR	3 000 000	2 698 001,48	0,09
CNP ASSURANCES 1.25% 27-01-29	EUR	15 900 000	14 151 270,65	0,49
FAIRFAX FINANCIAL 2.75% 29-03-28	EUR	4 300 000	4 137 126,90	0,14
GROUPAMA ASSURANCES MUTUELLES 6.0% 23-01-27	EUR	8 700 000	9 351 442,45	0,32
MAPFRE 2.875% 13-04-30	EUR	8 000 000	7 481 250,96	0,26
MAPFRE SA 4.375% 31-03-47	EUR	5 000 000	5 043 061,30	0,17
MUNICH RE 1.25% 26-05-41	EUR	3 000 000	2 512 656,37	0,09
MUTU ASSU DES 3.916% 06-10-49	EUR	500 000	510 741,76	0,02
PARTNERRE IRELAND FINANCE 1.25% 15-09-26	EUR	6 100 000	5 847 298,50	0,20
PERMANENT TSB GROUP 6.625% 25-04-28	EUR	2 000 000	2 132 594,93	0,07
PERMANENT TSB GROUP 6.625% 30-06-29	EUR	1 000 000	1 076 638,01	0,04
UNIQ VERS AG 6.0% 27-07-46	EUR	200 000	217 237,33	0,01
WUESTENROT WUERTTEMBERGISCHE AG 2.125% 10-09-41	EUR	10 100 000	8 229 993,00	0,28

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Automobiles			34 170 825,66	1,18
General Motors Financial Co Inc 3.9% 12-01-28	EUR	9 300 000	9 505 045,18	0,33
NEMAK SAB CV 2.25% 20-07-28	EUR	27 300 000	24 665 780,48	0,85
Banques commerciales			698 279 162,58	24,12
BANCA MEDIOLANUM 5.035% 22-01-27	EUR	8 300 000	8 627 443,84	0,30
BANCO BPM 3.375% 19-01-32	EUR	7 000 000	6 843 551,15	0,24
BANCO BPM 4.875% 18-01-27 EMTN	EUR	15 126 000	15 836 478,14	0,55
BANCO BPM 6.5% PERP	EUR	6 200 000	6 362 435,57	0,22
BANCO BPM 9.5% PERP	EUR	7 000 000	7 733 760,54	0,27
BANCO DE BADELL 2.625% 24-03-26	EUR	7 000 000	6 988 987,47	0,24
BANCO DE BADELL 5.25% 07-02-29	EUR	1 300 000	1 377 125,91	0,05
BANK MILLENNIUM 9.875% 18-09-27	EUR	18 800 000	21 652 616,46	0,75
BANK POLSKA KA OPIEKI 5.5% 23-11-27	EUR	8 850 000	9 326 135,80	0,32
BARCLAYS 0.877% 28-01-28	EUR	3 000 000	2 800 494,10	0,10
BARCLAYS 4.918% 08-08-30 EMTN	EUR	20 000 000	21 702 465,03	0,75
BBVA 4.625% 13-01-31	EUR	14 700 000	15 509 876,02	0,54
BCP 3.871% 27-03-30 EMTN	EUR	10 300 000	10 268 351,35	0,35
BCP 8.125% PERP	EUR	16 600 000	17 182 677,79	0,59
BCP 8.5% 25-10-25 EMTN	EUR	7 000 000	7 498 906,45	0,26
BK IRELAND 1.375% 11-08-31	EUR	3 300 000	3 160 070,98	0,11
BK IRELAND 2.375% 14-10-29	EUR	3 200 000	3 234 468,37	0,11
BNP PAR 0.25% 13-04-27 EMTN	EUR	8 000 000	7 517 743,56	0,26
BNP PAR 6.875% PERP	EUR	13 200 000	13 545 561,21	0,47
BPCE 1.5% 13-01-42	EUR	16 800 000	15 603 977,70	0,54
BPCE 2.125% 13-10-46	EUR	10 000 000	8 314 298,09	0,29
BQ POSTALE 3.0% PERP	EUR	10 000 000	7 741 304,35	0,27
CA 5.5% 28-08-33 EMTN	EUR	20 700 000	22 528 833,12	0,76
CA 7.25% PERP EMTN	EUR	6 100 000	6 313 640,90	0,22
CASSA CENTRALE RAIFFEISEN DELLALTO ADIG 5.885% 16-02-27	EUR	19 750 000	20 744 680,15	0,72
CMZB 4.0% 23-03-26 EMTN	EUR	10 000 000	10 109 134,93	0,35
CMZB FRANCFORT 6.5% 06-12-32	EUR	5 800 000	6 340 719,42	0,22
COOPERATIEVE RABOBANK UA 4.0% 10-01-30	EUR	17 100 000	17 796 079,33	0,61
COOPERATIEVE RABOBANK UA 4.375% PERP	EUR	5 000 000	4 759 818,03	0,16
COOPERATIEVE RABOBANK UA 4.875% PERP	EUR	4 200 000	3 940 732,28	0,14
CREDIT MUTUEL ARKEA 1.875% 25-10-29	EUR	5 000 000	5 020 743,03	0,17
CREDIT MUTUEL ARKEA 3.875% 22-05-28	EUR	10 300 000	10 442 477,22	0,36
CREDITO EMILIANO 1.125% 19-01-28	EUR	11 000 000	10 344 858,93	0,36
CRELAN 5.25% 23-01-32	EUR	3 500 000	3 737 017,42	0,13
CRELAN 6.0% 28-02-30 EMTN	EUR	9 700 000	10 518 503,49	0,36
DEUTSCHE BK 5.625% 19-05-31	EUR	5 000 000	5 102 954,11	0,18
DEUTSCHE BK PARIS BRANCH 10.0% PERP	EUR	2 000 000	2 189 420,55	0,08
DEUTSCHE BK PARIS BRANCH 4.0% 24-06-32	EUR	9 000 000	8 792 475,41	0,30
DEUTSCHE BK PARIS BRANCH 6.75% PERP	EUR	2 600 000	2 534 728,78	0,09
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 4.375% 28-08-26	EUR	15 800 000	15 893 243,31	0,55
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG EUAR05+2.75% 28-06-27	EUR	15 100 000	11 170 417,78	0,39
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRALGENOSSENSCH 1.026% 23-09-30	EUR	6 700 000	5 279 554,97	0,18
ERSTE GR BK 0.875% 22-05-26	EUR	4 000 000	3 809 891,51	0,13
ERSTE GR BK 7.0% PERP	EUR	21 000 000	20 843 793,28	0,72
HAMBURG COMMERCIAL BANK AG 4.875% 17-03-25	EUR	16 900 000	17 173 545,02	0,59
HAMBURG COMMERCIAL BANK AG E 4.75% 02-05-29	EUR	14 800 000	15 185 811,67	0,52

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
HSBC 3.019% 15-06-27	EUR	8 000 000	7 895 128,88	0,27
IBERCAJA 4.375% 30-07-28	EUR	5 900 000	6 067 668,97	0,21
ING GROEP NV 1.25% 16-02-27	EUR	2 000 000	1 931 787,92	0,07
INTE 1.0% 19-11-26 EMTN	EUR	20 000 000	18 919 297,27	0,65
JPMORGAN CHASE BANK NA 3.4% 15-02-29	EUR	19 900 000	20 088 928,39	0,69
KBC GROUPE 4.25% PERP	EUR	12 800 000	12 537 693,38	0,43
MBANK 0.966% 21-09-27 EMTN	EUR	4 100 000	3 767 437,24	0,13
MUENCHENER HYPOTHEKENBANK EG 7.125% 31-10-28	EUR	16 400 000	17 493 136,62	0,60
NCG BAN 10.625% PERP	EUR	12 800 000	14 557 436,84	0,50
NCG BAN 5.25% 14-09-28 EMTN	EUR	6 400 000	6 911 617,57	0,24
NCG BAN 5.5% 18-05-26 EMTN	EUR	15 000 000	15 290 637,33	0,53
NIBC BANK NV 6.0% 16-11-28	EUR	18 000 000	19 913 057,70	0,69
Nova Ljubljanska banka dd 6.0% 19-07-25	EUR	7 800 000	8 254 881,30	0,29
NOVO BAN 4.25% 08-03-28 EMTN	EUR	10 600 000	10 753 507,60	0,37
NOVO BAN 9.875% 01-12-33	EUR	14 000 000	17 035 606,99	0,59
PKO BANK POLSKI 5.625% 01-02-26	EUR	11 200 000	11 548 383,34	0,40
SG 1.125% 30-06-31 EMTN	EUR	5 300 000	4 953 309,21	0,17
SOCIETE GENERALE	EUR	5 000 000	4 798 116,26	0,17
UNICREDIT 1.625% 03-07-25 EMTN	EUR	8 000 000	8 129 124,81	0,28
UNICREDIT 2.731% 15-01-32	EUR	5 400 000	5 218 318,92	0,18
UNICREDIT 5.375% PERP	EUR	2 000 000	1 993 737,76	0,07
UNICREDIT 5.85% 15-11-27 EMTN	EUR	2 850 000	3 080 885,04	0,11
VOLKSBANK WIEN AG 0.875% 23-03-26	EUR	10 200 000	9 686 952,58	0,33
ZUERCHER KANTONALBANK 2.02% 13-04-28	EUR	8 400 000	8 050 706,14	0,28
Biens de consommation durables			33 402 242,71	1,15
ELECTROLUX AB 4.125% 05-10-26	EUR	2 000 000	2 072 616,07	0,07
ELECTROLUX AB 4.5% 29-09-28	EUR	25 000 000	26 301 184,43	0,91
NE PROPERTY BV 3.375% 14-07-27	EUR	5 000 000	5 028 442,21	0,17
Compagnies aériennes			38 418 675,15	1,33
AIR FR KLM 8.125% 31-05-28	EUR	8 800 000	9 815 196,93	0,34
AUSTRALIA PACIFIC AIRPORT MELBOURNE 4.0% 07-06-34	EUR	28 400 000	28 603 478,22	0,99
Composants automobiles			19 142 785,43	0,66
PIRELLI C 3.875% 02-07-29 EMTN	EUR	10 100 000	10 075 810,50	0,35
SCHAEFFLER AG 4.75% 14-08-29	EUR	8 800 000	9 066 974,93	0,31
Construction et ingénierie			31 467 376,43	1,09
ARCADIS NV 4.875% 28-02-28	EUR	6 800 000	7 118 101,21	0,25
CMC RAVENNA 2.0% 31-12-26	EUR	671 283	0,00	0,00
CYR 6.3% 23-03-26 EMTN	EUR	9 200 000	9 541 622,47	0,33
TECHNIP ENERGIES NV 1.125% 28-05-28	EUR	16 325 000	14 807 652,75	0,51
Crédit à la consommation			24 501 806,15	0,85
CAIXA CENTRAL DE CREDITO AGRICOLA MUTUO 8.375% 04-07-27	EUR	12 000 000	13 787 968,20	0,48
INTL PERSONAL FINANCE 10.75% 14-12-29	EUR	6 000 000	6 256 061,31	0,22
ZURICH FINANCE IRELAND DESIGNATED 1.875% 17-09-50	EUR	5 000 000	4 457 776,64	0,15
Distribution de produits alimentaires de première nécessité			52 729 346,57	1,82
ANIMA 1.5% 22-04-28	EUR	5 450 000	5 014 996,30	0,17
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCOMI 1.75% 22-07-26	EUR	4 200 000	4 031 679,61	0,14
MACQUARIE GROUP 4.7471% 23-01-30	EUR	24 600 000	26 222 051,48	0,91
WORLDLINE 4.125% 12-09-28 EMTN	EUR	17 000 000	17 460 619,18	0,60

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Eau			25 459 335,56	0,88
HIME SARLU 0.625% 16-09-28	EUR	13 000 000	11 128 808,42	0,38
HOLDING D INFRASTRUCTURES DES METIERS 4.5% 06-04-27	EUR	14 250 000	14 330 527,14	0,50
Electricité			45 566 103,29	1,57
EDF 3.75% 05-06-27 EMTN	EUR	10 500 000	10 571 179,21	0,37
EDF 4.0% PERP	EUR	5 000 000	5 147 958,88	0,18
ENBW ENERGIE BADENWUERTTEMBERG 1.375% 31-08-81	EUR	4 000 000	3 554 803,61	0,12
ORANO 5.375% 15-05-27 EMTN	EUR	6 600 000	6 878 246,05	0,24
RTE EDF TRANSPORT 3.75% 04-07-35	EUR	18 800 000	19 413 915,54	0,66
Epargne et prêts hypothécaires			17 910 722,50	0,62
CELLNEX FINANCE 1.25% 15-01-29	EUR	14 400 000	13 006 106,75	0,45
CELLNEX FINANCE 2.25% 12-04-26	EUR	5 000 000	4 904 615,75	0,17
Equipement et services pour l'énergie			1 531 554,75	0,05
TECHNIPFMC 6.5% 01-02-26	USD	1 598 000	1 531 554,75	0,05
Equipements et instruments électroniques			23 569 157,67	0,81
CARRIER GLOBAL CORPORATION 4.125% 29-05-28	EUR	5 000 000	5 113 812,33	0,18
CORNING 3.875% 15-05-26	EUR	18 350 000	18 455 345,34	0,63
Finances			9 414 357,53	0,33
EASYJET FINCO BV 1.875% 03-03-28	EUR	10 000 000	9 414 357,53	0,33
FPI de détail			4 675 465,75	0,16
MERCIALYS 2.5% 28-02-29	EUR	5 000 000	4 675 465,75	0,16
FPI Hôtel et Lieu de Villégiature			3 138 756,98	0,11
COVIVIO HOTELS SCA 1.0% 27-07-29	EUR	3 600 000	3 138 756,98	0,11
FPI résidentielles			11 521 759,13	0,40
ALTAREA COGEDIM 1.875% 17-01-28	EUR	12 600 000	11 521 759,13	0,40
Gaz			19 678 846,50	0,68
GALP GAS NATURAL DISTRIBUICAO 4.875% 03-07-28	EUR	18 300 000	19 678 846,50	0,68
Gestion et promotion immobilière			35 869 240,21	1,24
ACCENTRO REAL ESTATE AG 3.625% 13-02-26	EUR	5 903 000	2 268 016,15	0,08
ALTAREIT 2.875% 02-07-25	EUR	9 300 000	9 072 150,00	0,31
CASTELLUM HELSINKI FINANCE 0.875% 17-09-29	EUR	200 000	166 497,83	0,01
CPI PROPERTY GROUP 7.0% 07-05-29	EUR	22 800 000	22 663 991,75	0,78
PRAEMIA HEALTHCARE 1.375% 17-09-30	EUR	2 000 000	1 698 584,48	0,06
G CITY EUROPE 4.25% 11-09-25	EUR	5 000 000	4 995 252,32	0,17
Gestion immobilière et développement			27 407 848,13	0,95
CASTELLUM AB 0.75% 04-09-26	EUR	2 000 000	1 877 547,05	0,06
CITYCON OYJ 7.875% PERP	EUR	1 900 000	1 490 613,85	0,05
FASTIGHETS AB BALDER 1.125% 29-01-27	EUR	7 800 000	7 113 399,89	0,25
IMMOFINANZ AG 2.5% 15-10-27	EUR	4 500 000	4 017 792,91	0,14
VONOVIA SE 5.0% 23-11-30 EMTN	EUR	12 000 000	12 908 494,43	0,45
Grands magasins et autres			28 157 025,34	0,97
PROSUS NV 1.207% 19-01-26 EMTN	EUR	6 050 000	5 827 489,43	0,20
PROSUS NV 1.288% 13-07-29 EMTN	EUR	12 800 000	11 146 789,07	0,39
PROSUS NV 2.085% 19-01-30	EUR	12 600 000	11 182 746,84	0,38

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Hôtels, restaurants et loisirs			18 404 642,84	0,64
BOOKING 4.125% 12-05-33	EUR	17 800 000	18 404 642,84	0,64
Immobilier			18 528 916,78	0,64
VGP 1.5% 08-04-29	EUR	8 100 000	6 970 075,52	0,24
VGP 1.625% 17-01-27	EUR	12 400 000	11 558 841,26	0,40
Infrastructure de transports			70 308 158,06	2,43
AUTOSTRAD PER L ITALILIA 2.0% 04-12-28	EUR	4 500 000	4 199 220,25	0,15
AVINOR AS 3.5% 29-05-34 EMTN	EUR	36 750 000	36 284 387,57	1,25
HOLDING INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT 4.25% 18-03-30	EUR	5 300 000	5 416 904,57	0,19
SYDNEY AIRPORT FINANCE 4.375% 03-05-33	EUR	23 400 000	24 407 645,67	0,84
Logiciels			47 432 819,66	1,64
AENA 4.25% 13-10-30 EMTN	EUR	5 400 000	5 764 551,93	0,20
OCI NV 3.625% 15-10-25	EUR	21 500 000	19 326 847,19	0,66
POSAV 5.375% PERP	EUR	791 000	792 627,97	0,03
POSAV 9.5% PERP	EUR	17 000 000	18 998 447,54	0,66
STELLANTIS NV 4.25% 16-06-31	EUR	2 500 000	2 550 345,03	0,09
Machines			0,00	0,00
AGRIPOLE 5.0% 27-11-19	EUR	1 800 000	0,00	0,00
Marchés de capitaux			342 833 694,65	11,84
3I GROUP 4.875% 14-06-29	EUR	17 500 000	18 095 596,92	0,63
AIB GROUP 2.875% 30-05-31 EMTN	EUR	9 400 000	9 140 177,56	0,32
AIB GROUP 7.125% PERP	EUR	7 800 000	7 909 350,89	0,27
ATRIUM FINANCE ISSUER BV 2.625% 05-09-27	EUR	1 500 000	1 304 269,67	0,05
BANCO NTANDER 5.75% 23-08-33	EUR	20 100 000	21 953 634,08	0,76
BANCO SANTANDER ALL SPAIN BRANCH 1.625% 22-10-30	EUR	5 000 000	4 362 886,61	0,15
BANCO SANTANDER ALL SPAIN BRANCH 7.0% PERP	EUR	29 000 000	29 378 431,09	0,98
CESKA SPORITELNA AS 4.824% 15-01-30	EUR	12 000 000	12 457 257,05	0,43
CESKA SPORITELNA AS 5.737% 08-03-28	EUR	4 700 000	4 941 897,99	0,17
CRED SUIS SA AG LONDON BRANCH 0.25% 05-01-26	EUR	5 800 000	5 517 468,53	0,19
CRED SUIS SA AG LONDON BRANCH 5.5% 20-08-26	EUR	5 000 000	5 431 533,06	0,19
EAD 1.375% 13-05-31 EMTN	EUR	30 000 000	26 389 906,85	0,91
ERSTESTEIERMAERKISCHE BANKA DD 0.75% 06-07-28	EUR	19 400 000	17 568 310,84	0,61
FINANCIERE APSYS 7.0% 06-10-27	EUR	2 400 000	2 602 426,43	0,09
GRENKE FINANCE 3.95% 09-07-25	EUR	7 100 000	7 350 413,70	0,25
GRENKE FINANCE 5.75% 06-07-29	EUR	17 550 000	17 827 594,01	0,62
IM GROUP SAS 8.0% 01-03-28	EUR	7 600 000	5 838 607,11	0,20
JAB HOLDINGS BV 1.0% 20-12-27	EUR	2 400 000	2 212 218,89	0,08
JULIUS BAER GRUPPE AG 6.625% PERP	EUR	5 000 000	4 989 233,79	0,17
MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ 0.75% 02-11-28	EUR	9 400 000	8 584 874,38	0,30
MOTABILITY OPERATIONS GROUP 4.0% 17-01-30	EUR	18 650 000	18 910 248,52	0,65
NORDDEUTSCHE LANDESBANK GIROZENTRALE 5.625% 23-08-34	EUR	25 000 000	24 983 563,52	0,86
OTP BANK 5.0% 31-01-29 EMTN	EUR	26 200 000	26 867 487,95	0,93
RAIFFEISEN BANK INTL AG 1.5% 12-03-30	EUR	5 000 000	4 834 588,70	0,17
RAIFFEISEN BANK INTL AG 4.625% 21-08-29	EUR	2 200 000	2 230 591,72	0,08
RAIFFEISEN BANK INTL AG 7.375% 20-12-32	EUR	3 700 000	4 009 368,22	0,14
TRANSBURBAN FINANCE COMPANY 3.713% 12-03-32	EUR	18 850 000	19 047 704,74	0,66
VAN LANSCHOT KEMPEN NV 8.875% PERP	EUR	9 600 000	10 568 198,67	0,37
WINTERSHALL DEA SCHWEIZ BV 0.84% 25-09-25	EUR	18 100 000	17 525 853,16	0,61

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Media			3 016 221,89	0,10
IPSOS 2.875% 21-09-25	EUR	3 000 000	3 016 221,89	0,10
Pétrole et gaz			41 857 110,96	1,45
AKER BP A 1.125% 12-05-29 EMTN	EUR	6 000 000	5 326 931,51	0,18
BP CAP MK 3.25% PERP	EUR	6 400 000	6 267 714,63	0,22
ENI 2.625% PERP	EUR	5 000 000	4 927 796,72	0,17
TOTALENERGIES SE FR 2.0% PERP	EUR	4 250 000	3 997 759,88	0,14
VAR ENERGI A 5.5% 04-05-29	EUR	20 000 000	21 336 908,22	0,74
Producteur et commerce d'énergie indépendants			24 224 096,16	0,84
Industrial Power Corporation 4.75% 01-06-30	EUR	20 000 000	20 677 684,93	0,72
TEOLLISUUJEN VOIMA OY 1.125% 09-03-26	EUR	3 700 000	3 546 411,23	0,12
Produits alimentaires			18 990 282,21	0,66
PICARD GROUPE 3.875% 01-07-26	EUR	18 990 000	18 990 282,21	0,66
Produits chimiques			52 056 521,15	1,80
Koninklijke DSM NV 3.625% 02-07-34	EUR	18 400 000	18 239 460,00	0,63
KS AKTUELL AG 4.25% 19-06-29	EUR	15 400 000	15 396 668,96	0,53
PPG INDUSTRIES 2.75% 01-06-29	EUR	9 000 000	8 678 030,55	0,30
SYENSQO SANV 2.5% PERP	EUR	10 000 000	9 742 361,64	0,34
Produits pharmaceutiques			11 322 579,40	0,39
UCB 4.25% 20-03-30 EMTN	EUR	11 200 000	11 322 579,40	0,39
Services aux collectivités			225 386 584,27	7,79
ADIF ALTA VELOCIDAD 3.9% 30-04-33	EUR	23 000 000	23 562 039,66	0,81
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0.0% 15-08-29	EUR	210 000 000	185 817 450,00	6,43
IBERDROLA FINANZAS SAU 4.871% PERP	EUR	15 600 000	16 007 094,61	0,55
Services aux entreprises			67 902 659,20	2,35
CRHCAISSE DE REFINANCEMENT DE L HABITAT 2.875% 25-03-31	EUR	10 000 000	9 888 029,45	0,34
ELIS EX HOLDELIS 4.125% 24-05-27	EUR	500 000	502 986,27	0,02
EURONET WORLDWIDE 1.375% 22-05-26	EUR	9 600 000	9 160 315,40	0,32
LA POSTE 4.0% 12-06-35 EMTN	EUR	25 000 000	25 646 419,52	0,88
SECURITAS TREASURY IRELAND DAC 4.25% 04-04-27	EUR	7 500 000	7 679 985,10	0,27
SHEARWATER GEOSERVICES 9.5% 03-04-29	USD	15 800 000	15 024 923,46	0,52
Services aux professionnels			12 151 431,13	0,42
LOTTOMATICA E3R+4.0% 15-12-30	EUR	11 900 000	12 151 431,13	0,42
Services clientèle divers			58 531 711,33	2,02
ALD 4.0% 05-07-27 EMTN	EUR	4 000 000	4 193 968,52	0,14
AYVENS 4.25% 18-01-27 EMTN	EUR	8 000 000	8 260 087,65	0,29
EDENRED 3.625% 13-06-31	EUR	21 500 000	21 292 997,71	0,74
KLESIA PREVOYANCE 5.375% 08-12-26	EUR	10 700 000	11 085 463,11	0,38
LEASYS 4.5% 26-07-26 EMTN	EUR	13 000 000	13 699 194,34	0,47
Services de télécommunication diversifiés			5 336 473,44	0,18
TDF INFRASTRUCTURE SAS 1.75% 01-12-29	EUR	6 000 000	5 336 473,44	0,18
Services de télécommunication mobile			4 154 082,66	0,14
INFRASTRUTTURA WIRELESS ITALIANE 1.625% 20-10-28	EUR	4 450 000	4 154 082,66	0,14
Services financiers diversifiés			367 269 892,94	12,69
ACEF HOLDING SCA 0.75% 14-06-28	EUR	4 350 000	3 833 632,65	0,13

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ALIAxis FINANCE 0.875% 08-11-28	EUR	12 000 000	10 625 291,80	0,37
Banca Ifis 5.5% 27-02-29 EMTN	EUR	2 000 000	2 058 648,85	0,07
Banca Ifis 6.875% 13-09-28	EUR	23 250 000	25 867 893,46	0,89
BANQUE INTLE A LUXEMBOURG 1.75% 18-08-31	EUR	3 000 000	2 732 633,20	0,09
BAWAG GROUP 5.0% PERP	EUR	2 400 000	2 349 318,26	0,08
BFCM 2.375% 24-03-26 EMTN	EUR	10 000 000	9 822 468,49	0,34
BFCM BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL 0.25% 19-07-28	EUR	15 000 000	13 039 258,20	0,45
BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS 1.25% 26-04-27	EUR	10 000 000	9 198 195,21	0,32
CA AUTO BANK SPA IRISH BRANCH 4.75% 25-01-27	EUR	17 450 000	18 230 019,29	0,63
CCF 9.25% PERP	EUR	3 000 000	3 035 548,93	0,10
CETIN FINANCE BV 3.125% 14-04-27	EUR	18 000 000	17 660 856,58	0,61
CT INVESTMENT 6.375% 15-04-30	EUR	5 000 000	5 172 856,25	0,18
DELL BANK INTL DAC 4.5% 18-10-27	EUR	12 650 000	13 357 657,59	0,46
ENEL FINANCE INTL NV 0.25% 17-06-27	EUR	15 000 000	13 636 841,10	0,47
ETHIAS VIE 5.0% 14-01-26	EUR	7 100 000	7 349 806,71	0,25
ETHIAS VIE 6.75% 05-05-33 EMTN	EUR	8 700 000	9 602 981,94	0,33
GE 3.65 08/23/32	EUR	5 300 000	5 321 672,80	0,18
GROUPE BRUXELLES LAMBERT 4.0% 15-05-33	EUR	20 000 000	20 526 105,48	0,71
GROUPE DES ASSURANCES CREDIT MUTUEL 5.0% 30-10-44	EUR	10 100 000	10 035 880,73	0,35
HERAEUS FINANCE 2.625% 09-06-27	EUR	15 100 000	14 681 414,55	0,51
IKB DEUTSCHE INDUSTRIEBANK AG EUSA5+3.617% 31-01-28	EUR	4 900 000	4 735 977,32	0,16
INDIGO GROUP 4.5% 18-04-30	EUR	15 000 000	15 462 623,63	0,53
JDE PEET S BV 4.125% 23-01-30	EUR	9 100 000	9 359 854,98	0,32
LOGICOR FINANCING SARL 0.875% 14-01-31	EUR	4 900 000	3 890 669,62	0,13
LOGICOR FINANCING SARL 1.625% 15-07-27	EUR	3 500 000	3 283 954,85	0,11
LOGICOR FINANCING SARL 4.625% 25-07-28	EUR	5 050 000	5 185 830,93	0,18
NESTLE FIN 3.75% 13-03-33 EMTN	EUR	25 000 000	26 294 227,74	0,94
NIBC BANK NV 6.0% PERP	EUR	4 200 000	4 258 303,92	0,15
RENTOKIL INITIAL FINANCE BV 3.875% 27-06-27	EUR	4 800 000	4 831 011,95	0,17
SOGECAP 6.5% 16-05-44	EUR	9 600 000	10 333 918,68	0,36
TIKEHAU CAPITAL 2.25% 14-10-26	EUR	4 300 000	4 203 471,70	0,15
TIKEHAU CAPITAL 6.625% 14-03-30	EUR	4 300 000	4 770 509,24	0,16
TRAFIGURA FUNDING 3.875% 02-02-26	EUR	22 550 000	22 608 450,09	0,78
TRATON FINANCE LUXEMBOURG 4.0% 16-09-25	EUR	19 100 000	19 719 680,19	0,68
TRATON FINANCE LUXEMBOURG 4.25% 16-05-28	EUR	10 000 000	10 192 426,03	0,35
Services liés aux technologies de l'information			58 624 211,30	2,03
CZECH GAS NETWORKS SA RL 0.45% 08-09-29	EUR	11 800 000	9 966 739,43	0,34
FLUTTER TREASURY DAC 5.0% 29-04-29	EUR	4 500 000	4 615 537,50	0,16
TDC NET AS 5.056% 31-05-28	EUR	17 000 000	17 425 725,18	0,61
TDC NET AS 5.186% 02-08-29	EUR	9 400 000	9 630 224,93	0,33
THALES SERVICES SAS 4.25% 18-10-31	EUR	16 000 000	16 985 984,26	0,59
SIIC spécialisées dans le crédit hypothécaire			36 803 928,02	1,27
NYKREDIT 4.625% 19-01-29 EMTN	EUR	28 100 000	29 633 288,02	1,02
UMG GROUPE VYV 1.625% 02-07-29	EUR	8 000 000	7 170 640,00	0,25
Sociétés d'investissement immobilier (SII)			6 468 474,36	0,22
HEIMSTADEN AB 4.25% 09-03-26	EUR	1 600 000	1 202 160,44	0,04
HEIMSTADEN AB 4.375% 06-03-27	EUR	4 800 000	3 431 962,67	0,12
HEIMSTADEN AB 6.75% PERP	EUR	4 700 000	1 834 351,25	0,06

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Sociétés d'investissement immobilier cotées (SIIC)			33 968 753,78	1,17
CITYCON TREASURY BV 1.625% 12-03-28	EUR	3 000 000	2 584 083,90	0,09
CITYCON TREASURY BV 6.5% 08-03-29	EUR	4 000 000	4 089 710,14	0,14
CREDIT LOGEMENT 1.35% 28-11-29	EUR	7 800 000	7 751 749,97	0,27
SELP FINANCE SARL 1.5% 20-12-26	EUR	3 700 000	3 517 115,67	0,12
UNIBAIL RODAMCO SE 7.25% PERP	EUR	14 500 000	16 026 094,10	0,55
Textiles, habillement et produits de luxe			18 529 418,85	0,64
KERING 3.625% 05-09-31 EMTN	EUR	18 000 000	18 529 418,85	0,64
TITRES D'OPC			44 807 653,90	1,55
OPCVM			44 807 653,90	1,55
Gestion collective			44 807 653,90	1,55
R-CO 4CHANGE NET ZERO CREDIT EURO C	EUR	100 480,7026	3 895 636,84	0,13
R-CO CONVICTION HIGH YIELD EURO PART IC EUR	EUR	908	1 203 417,80	0,04
R-CO CONVICTION SUBFIN C EUR	EUR	1 000	97 550,00	0,00
R-CO CONVICTION SUBFIN ID EUR	EUR	2 000	1 854 580,00	0,06
R-CO CONVICTION SUBFIN I EUR	EUR	3 665	3 616 365,45	0,12
R-CO TARGET 2027 HY I CHF H	CHF	2 000	2 191 924,43	0,08
R-CO TARGET 2029 IG IC2 EUR	EUR	2 000	2 046 100,00	0,07
R-CO TARGET 2029 IG P2 EUR	EUR	1 000	101 850,00	0,00
R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES P CHF H	CHF	1 000	110 981,94	0,00
RMM COURT TERME C	EUR	7 208	29 689 247,44	1,05
Total			2 920 318 044,89	100,90

(*) Le secteur d'activité représente l'activité principale de l'émetteur de l'instrument financier ; il est issu de sources fiables reconnues au plan international (GICS et NACE principalement).

Inventaire des opérations à terme de devises

Type d'opération	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)			
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)	
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)
V GBP EUR 13/09/24	19 154,83	0,00	EUR	6 850 666,11	GBP	-6 831 511,28
Total	19 154,83	0,00		6 850 666,11		-6 831 511,28

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions exprimé dans la devise de comptabilisation.

Inventaire des instruments financiers à terme

Inventaire des instruments financiers à terme - actions

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - taux d'intérêts

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
EURO BOBL 0924	1 058	412 040,00	0,00	123 193 520,00
Sous-total 1.		412 040,00	0,00	123 193 520,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		412 040,00	0,00	123 193 520,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - de change

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - sur risque de crédit

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
ALSTOM 3.0 07-19_201	-6 500 000	0,00	-55 755,05	-6 500 000,00
ALSTOM 3.0 07-19_201	-6 500 000	0,00	-52 332,80	-6 500 000,00
ITRAXX EUROPE S41 V1	-608 000 000	0,00	-10 981 817,60	-608 000 000,00
Sous-total 4.		0,00	-11 089 905,45	-621 000 000,00
Total		0,00	-11 089 905,45	-621 000 000,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - autres expositions

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme ou des opérations à terme de devises utilisés en couverture d'une catégorie d'action

Type d'opération	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)				Classe de part couverte
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)		
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)	
A CHF EUR 13/09/24	0,00	-4,90	CHF	10 433,02	EUR	-10 437,92	FR0011829068
A CHF EUR 13/09/24	0,00	-3 772,09	CHF	506 103,73	EUR	-509 875,82	FR0011839885
A CHF EUR 13/09/24	0,00	-549,71	CHF	1 170 440,17	EUR	-1 170 989,88	FR0011839919
A CHF EUR 13/09/24	0,00	-11 660,55	CHF	24 827 778,10	EUR	-24 839 438,65	FR0011839885
A USD EUR 13/09/24	38,69	0,00	USD	17 686,40	EUR	-17 647,71	FR0011839877
A USD EUR 13/09/24	0,00	-73,75	USD	58 644,68	EUR	-58 718,43	FR0011839877
A USD EUR 13/09/24	101 790,36	0,00	USD	20 793 001,09	EUR	-20 691 210,73	FR0011839927
A USD EUR 13/09/24	3 861,90	0,00	USD	788 880,73	EUR	-785 018,83	FR0011839877
Total	105 690,95	-16 061,00		48 172 967,92		-48 083 337,97	

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions exprimé dans la devise de comptabilisation.

Synthèse de l'inventaire

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	2 920 318 044,89
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	19 154,83
Total instruments financiers à terme - actions	0,00
Total instruments financiers à terme - taux	412 040,00
Total instruments financiers à terme - change	0,00
Total instruments financiers à terme - crédit	-11 089 905,45
Total instruments financiers à terme - autres expositions	0,00
Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises	89 629,95
Autres actifs (+)	15 469 990,99
Autres passifs (-)	-30 834 459,95
Passifs de financement (-)	0,00
Total = actif net	2 894 384 495,26

Libellé de l'action	Devise de l'action	Nombre d'actions	Valeur liquidative
Action R-CO CONVICTION CREDIT EURO C CHF H	CHF	10,0007	1 006,37
Action R-CO CONVICTION CREDIT EURO C EUR	EUR	1 603 443,7976	456,81
Action R-CO CONVICTION CREDIT EURO C USD H	USD	728,1835	1 277,62
Action R-CO CONVICTION CREDIT EURO D EUR	EUR	26 436,6781	271,42
Action R-CO CONVICTION CREDIT EURO F EUR	EUR	523 719,7737	151,74
Action R-CO CONVICTION CREDIT EURO IC CHF H	CHF	22 919,2094	1 060,72
Action R-CO CONVICTION CREDIT EURO IC EUR	EUR	736 208,3408	1 456,64
Action R-CO CONVICTION CREDIT EURO ID EUR	EUR	414,3669	96 764,02
Action R-CO CONVICTION CREDIT EURO M EUR	EUR	1 772,0538	1 085,30
Action R-CO CONVICTION CREDIT EURO MF EUR	EUR	54 985,8829	914,88
Action R-CO CONVICTION CREDIT EURO PB EUR	EUR	116 470,2926	909,74
Action R-CO CONVICTION CREDIT EURO P CHF H	CHF	1 063,0444	1 056,80
Action R-CO CONVICTION CREDIT EURO P EUR	EUR	331 350,8370	1 131,05
Action R-CO CONVICTION CREDIT EURO P USD H	USD	16 855,5104	1 321,98
Action R-CO CONVICTION CREDIT EURO R EUR	EUR	1 278 816,4504	10,08
Action R-CO CONVICTION CREDIT EURO SI EUR	EUR	356 051,4643	1 035,91