

# **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 30 juin 2023

## 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 30 juin 2023

---

En notre qualité de commissaire aux comptes de la SICAV R-CO et en application des dispositions prévues par l'article L 214-24-49 du Code monétaire et financier relatives au contrôle de la composition de l'actif, nous avons établi la présente attestation sur les informations figurant dans la composition de l'actif du compartiment R-co Conviction Credit Euro au 30 juin 2023 ci-jointe.

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

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

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

A Paris La Défense, le 01 septembre 2023

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés

Olivier GALIENNE

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

V A L E U R	STATUTS DOSSIER	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

0 - Actions & Valeurs assimilées

Actions & valeurs assimilées négo. sur un marché réglementé

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

DEVISE VALEUR : EUR EURO

ES0105200002	ABENGOA CL B	12,706,492.	P EUR	0.	M 24/05/22	0.	V	0.00	0.00	0.00	0.00 0.00
ES0105200416	ABENGOA SA	1,228,837.	P EUR	0.	M 24/05/22	0.	V	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

Actions & valeurs assimilées non négociés sur un marché réglementé

Actions & valeurs ass. non négo. sur un marc

hé réglementé

DEVISE VALEUR : EUR EURO

XFCS00X3EK7	SFP 2020 CMC RAVENNA	1,342,565.	P EUR	0.	M		A	0.00	0.00	0.00	0.00 0.00
-------------	----------------------	------------	-------	----	---	--	---	------	------	------	-----------

0 - Actions & Valeurs assimilées

CUMUL (EUR) 0.00 0.00 0.00 0.00

I - Obligations & Valeurs assimilées

Obligations & valeurs assimilées négociés sur un marché réglementé

Obligations à taux fixe négo. sur un marché regl.

DEVISE VALEUR : EUR EURO

XS2626289222	3I GROU 4.875 06-29	(366) 140629	17,500,000.	M EUR	98.506	% 30/06/23	98.7445	4	17,238,550.00	17,326,906.35	46,618.85	88,356.35 0.96
XS1877540465	AB SAGA 2.0 01-24	(366) 170124	6,600,000.	M EUR	99.834	% 30/06/23	97.924	4	6,589,044.00	6,523,740.16	60,756.16	-65,303.84 0.36
ES0265936031	ABAN CO 5.25 09-28	(366) 140928	6,400,000.	M EUR	99.721	% 30/06/23	98.335	E	6,382,144.00	6,563,160.55	269,720.55	181,016.55 0.37
ES0365936048	ABAN CO 5.5 05-26	(366) 180526	15,000,000.	M EUR	99.8384	% 30/06/23	99.443	4	14,975,760.00	15,022,392.62	105,942.62	46,632.62 0.84
DE000A254YS5	ACCE RE 3.625 02-26	(UST) 130226	5,903,000.	M EUR	83.5813	% 30/06/23	60.649	4	4,440,423.63	3,338,498.19	116,398.76	-1,101,925.44 0.19
XS2351301499	ACEF HO 0.75 06-28	(366) 140628	4,350,000.	M EUR	99.364	% 30/06/23	81.867	4	4,322,334.00	3,562,997.29	1,782.79	-759,336.71 0.20
XS2056490423	ACHM BV 4.625 PERP	(366) 311299	5,800,000.	M EUR	111.9494	% 30/06/23	77.8655	4	6,493,064.54	4,590,957.20	74,758.20	-1,902,107.34 0.26
ES0200002089	ADIF AL 3.9 04-33	(366) 300433	23,000,000.	M EUR	99.8104	% 30/06/23	101.233	4	22,956,382.00	23,450,245.74	166,655.74	493,863.74 1.31
BE6325355822	AGEA NV 1.875 11-51	(366) 241151	6,200,000.	M EUR	99.626	% 30/06/23	72.8995	4	6,176,812.00	4,590,474.48	70,705.48	-1,586,337.52 0.26
BE6317598850	AGEAS NV 3.875 PERP	(366) 311299	8,000,000.	M EUR	102.1885	% 30/06/23	72.449	4	8,175,076.16	5,816,247.87	20,327.87	-2,358,828.29 0.32
FR0012317451	AGRI POLE 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
XS2230399441	AIB GRO 2.875 05-31	(366) 300531	9,400,000.	M EUR	99.952	% 30/06/23	90.8095	4	9,395,488.00	8,561,936.58	25,843.58	-833,551.42 0.48
FR0013477254	AIR FR 1.875 01-25	(366) 160125	7,500,000.	M EUR	90.7769	% 30/06/23	94.0365	4	6,808,265.40	7,117,848.80	65,111.30	309,583.40 0.40
FR001400F2R8	AIR FR 8.125 05-28	(366) 310528	8,800,000.	M EUR	99.547	% 30/06/23	103.76	4	8,760,136.00	9,197,300.77	66,420.77	437,164.77 0.51
XS2341269970	AKER BP 1.125 05-29	(366) 120529	6,000,000.	M EUR	99.356	% 30/06/23	83.351	4	5,961,360.00	5,010,834.59	9,774.59	-950,525.41 0.28
XS2498554992	ALD 4.0 07-27	(366) 050727	4,000,000.	M EUR	101.8269	% 30/06/23	99.0295	4	4,073,076.71	4,120,741.64	159,561.64	47,664.93 0.23
FR001400F6E7	ALD 4.25 01-27	(366) 180127	8,000,000.	M EUR	101.2329	% 30/06/23	99.761	4	8,098,630.14	8,136,441.64	155,561.64	37,811.50 0.45
BE6331562817	ALIA FI 0.875 11-28	(366) 081128	12,000,000.	M EUR	97.9179	% 30/06/23	79.887	4	11,750,151.97	9,654,905.75	68,465.75	-2,095,246.22 0.54
DE0001135481	ALLEMAGNE 2.5% 2044	(366) 040744	30,000,000.	M EUR	100.2094	% 30/06/23	100.989	4	30,062,815.07	30,296,700.00	0.00	233,884.93 1.69
DE000A3E5TRO	ALLI SE 2.6 PERP	(366) 311299	7,000,000.	M EUR	100.008	% 30/06/23	66.794	4	7,000,560.00	4,707,902.40	32,322.40	-2,292,657.60 0.26
FR0013346814	ALTA 2.875 07-25	(366) 020725	9,300,000.	M EUR	99.265	% 30/06/23	92.811	4	9,231,645.00	8,632,884.07	1,461.07	-598,760.93 0.48
FR0013453974	ALTA CO 1.875 01-28	(366) 170128	4,000,000.	M EUR	99.241	% 30/06/23	80.9185	4	3,969,640.00	3,271,260.55	34,520.55	-698,379.45 0.18
XS2331921390	ANIMA 1.5 04-28	(366) 220428	5,450,000.	M EUR	99.408	% 30/06/23	85.2915	4	5,417,736.00	4,664,692.08	16,305.33	-753,043.92 0.26
FR0013455862	APIC PR 4.0 10-29	(366) 241029	7,900,000.	M EUR	100.0886	% 30/06/23	89.722	4	7,907,000.00	7,307,073.62	219,035.62	-599,926.38 0.41
XS2079716937	APPLE 0.5 11-31	(366) 151131	6,665,000.	M EUR	80.2026	% 30/06/23	80.82	4	5,345,506.23	5,407,743.62	21,090.62	62,237.39 0.30









Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	Devise du portefeuille				PRCT ACT NET	
									<-----> PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL		
XS0808635436 UQA 6.875% 31/07/43		(366) 310743	200,000.	M EUR	104.6731	% 30/06/23	100.1635	4	209,346.25	213,059.88	12,732.88	3,713.63	0.01	
XS1892756682 VAN LAN 6.75 PERP		(EUR) 311299	5,200,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	93.799	4	5,200,000.00	4,968,223.00	90,675.00	-231,777.00	0.28	
XS2599156192 VAR ENE 5.5 05-29		(366) 040529	20,000,000.	M EUR	100.4904	% 30/06/23	99.805	4	20,098,075.21	20,144,333.33	183,333.33	46,258.12	1.12	
BE6327721237 VGP 1.5 04-29		(366) 080429	8,100,000.	M EUR	99.522	% 30/06/23	69.528	4	8,061,282.00	5,660,649.15	28,881.15	-2,400,632.85	0.32	
BE6332786449 VGP 1.625 01-27		(366) 170127	12,400,000.	M EUR	90.4899	% 30/06/23	81.047	4	11,220,752.33	10,142,573.21	92,745.21	-1,078,179.12	0.56	
XS2389688875 VI TE FI 1.0 09-28		(366) 240928	8,400,000.	M EUR	94.413	% 30/06/23	84.496	4	7,930,693.00	7,162,792.77	65,128.77	-767,900.23	0.40	
AT000B122080 VOLK WI 0.875 03-26		(366) 230326	10,200,000.	M EUR	99.456	% 30/06/23	88.168	4	10,144,512.00	9,018,252.80	25,116.80	-1,126,259.20	0.50	
DE000A30VQB2 VONO SE 5.0 11-30		(366) 231130	12,000,000.	M EUR	100.3995	% 30/06/23	97.8575	4	12,047,945.00	12,109,475.34	366,575.34	61,530.34	0.67	
XS2392462730 WERF 0.5 10-26		(366) 281026	2,500,000.	M EUR	99.45	% 30/06/23	87.697	4	2,486,250.00	2,200,952.40	8,527.40	-285,297.60	0.12	
XS2054209833 WINT DE 0.84 09-25		(366) 250925	18,100,000.	M EUR	97.8139	% 30/06/23	92.1535	4	17,704,323.13	16,797,250.02	117,466.52	-907,073.11	0.93	
XS2433361719 WIZZ AI 1.0 01-26		(366) 190126	12,700,000.	M EUR	93.873	% 30/06/23	88.417	4	11,921,874.95	11,286,717.90	57,758.90	-635,157.05	0.63	
XS2378468420 WUES WU 2.125 09-41		(366) 100941	10,100,000.	M EUR	99.1285	% 30/06/23	70.829	4	10,011,980.53	7,328,369.07	174,640.07	-2,683,611.46	0.41	
CH1170565753 ZURC KA 2.02 04-28		(366) 130428	8,400,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	90.7755	4	8,400,000.00	7,663,157.74	38,015.74	-736,842.26	0.43	
XS2189970317 ZURI FI 1.875 09-50		(366) 170950	5,000,000.	M EUR	99.699	% 30/06/23	80.1625	4	4,984,950.00	4,082,611.30	74,486.30	-902,338.70	0.23	
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>														
									CUMUL (EUR)	1,883,198,760.01	1,779,348,095.58	21,928,873.57	-103,850,664.43	99.04
<b>DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING</b>														
FR0014003YZ5 CLAR 4.125 PERP		(366) 311299	5,800,000.	M GBP	99.655	% 30/06/23	80.789	4	6,713,112.66	5,473,950.32	14,470.90	-1,239,162.34	0.30	
<b>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</b>														
USG87110AC93 TECH 6.5 02-26		(EUR) 010226	1,598,000.	M USD	100.	% 30/06/23	99.062	E	1,314,360.91	1,497,474.24	40,626.50	183,113.33	0.08	
<b>Obligations à taux variable, révisable négo. sur u</b>														
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>														
XS1978210273 ABEN AB 1.5 10-24		(EUR) 261024	4,738,730.	P EUR	0.	M 30/06/23	0.	E	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
DE000DL19WG7 DEUT BK FLR PERP		(366) 311299	2,600,000.	M EUR	100.014	% 30/06/23	81.2925	4	2,600,364.00	2,144,773.03	31,168.03	-455,590.97	0.12	
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>														
									CUMUL (EUR)	2,600,364.00	2,144,773.03	31,168.03	-455,590.97	0.12
<b>Obligations convertibles négo. sur un marché regl.</b>														
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>														
XS1978209002 ABEN AB 1.5 10-24		(EUR) 261024	4,738,730.	P EUR	0.	M 30/06/23	0.	E	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	
FR0013457942 ATOS SE ZCP 11-24		(999) 061124	5,200,000.	M EUR	77.4504	% 30/06/23	87.806	4	4,027,423.00	4,565,912.00	0.00	538,489.00	0.25	
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>														
									CUMUL (EUR)	4,027,423.00	4,565,912.00	0.00	538,489.00	0.25
<b>Obligations &amp; valeurs assimilées négociés sur un marché réglementé</b>														
									CUMUL (EUR)	1,897,854,020.58	1,793,030,205.17	22,015,139.00	-104,823,815.41	99.80

III - Titres d'OPCVM



## Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

V A L E U R	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P. R. U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<-----> PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	<-----> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET	
<b>OPCVM français à vocation générale</b>													
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
FR00140060V1	R-CO CONV SUBFIN ID	2,000.	P EUR	1000.	M 29/06/23	860.24	5	2,000,000.00	1,720,480.00	0.00	-279,520.00	0.10	
FR00140060X7	R-CO CONV SUBFIN I	3,665.	P EUR	1000.	M 29/06/23	885.43	5	3,665,000.00	3,245,100.95	0.00	-419,899.05	0.18	
FR00140060Y5	R-CO CONV SUBFIN C	1,000.	P EUR	100.	M 29/06/23	87.76	5	100,000.00	87,760.00	0.00	-12,240.00	0.00	
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
CUMUL (EUR)								5,765,000.00	5,053,340.95	0.00	-711,659.05	0.28	
<b>OPCVM européens coordonnés et assimilables</b>													
<b>DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE</b>													
FR001400BUA5	R-CO TR 28 IG P CHF	1,000.	P CHF	100.	M 29/06/23	98.7	5	101,122.46	100,837.76	0.00	-284.70	0.01	
FR0014009K66	R-CO VAL BD OPP P CH	1,000.	P CHF	100.	M 29/06/23	102.64	5	101,122.46	104,863.10	0.00	3,740.64	0.01	
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE</b>													
CUMUL (EUR)								202,244.92	205,700.86	0.00	3,455.94	0.01	
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
FR0007393285	R-CO 4CHANGE NETZ C	100,480.7026	P EUR	36.231	M 29/06/23	36.64	5	3,640,519.50	3,681,612.94	0.00	41,093.44	0.20	
FR0007442496	RMM COURT TERME C	50.	P EUR	3969.434	M 29/06/23	3970.52	5	198,471.70	198,526.00	0.00	54.30	0.01	
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
CUMUL (EUR)								3,838,991.20	3,880,138.94	0.00	41,147.74	0.22	
<b>III - Titres d'OPCVM</b>													
CUMUL (EUR)								9,806,236.12	9,139,180.75	0.00	-667,055.37	0.51	
<b>VII - AUTRES ENGAGEMENTS</b>													
<b>Dérivés de crédits</b>													
<b>Credit Default Swap (CDS)</b>													
<b>DATE ECHEANCE : 20/06/28</b>													
CDS027149302	ITRAXX EUR XOVER S39	APROT 20/06/28	-65,000,000.	EUR	0.	% 30/06/23	-3.96369	H	0.00	-2,675,704.06	-99,305.56	-2,675,704.06	-0.15
CDS027295102	ITRAXX EUR XOVER S39	APROT 20/06/28	-70,000,000.	EUR	0.	% 30/06/23	-3.96369	H	0.00	-2,881,527.44	-106,944.44	-2,881,527.44	-0.16
<b>SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 20/06/28</b>													
CUMUL (EUR)								0.00	-5,557,231.50	-206,250.00	-5,557,231.50	-0.31	
<b>VIII - TRESORERIE</b>													
<b>Dettes et créances</b>													
<b>Règlements différés</b>													
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
ARDEUR	Ach rgl t différé	-30,185,051.07	EUR	1.	30/06/23	1.			-30,185,051.07	-30,185,051.07	0.00	0.00	-1.68
VRDEUR	Vte rgl t différé	18,856,611.5	EUR	1.	30/06/23	1.			18,856,611.50	18,856,611.50	0.00	0.00	1.05
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
CUMUL (EUR)								-11,328,439.57	-11,328,439.57	0.00	0.00	-0.63	
<b>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</b>													
ARDUSD	Ach rgl t différé	144,300.	USD	0.92208392	30/06/23	0.92030186			133,056.71	132,799.56	0.00	-257.15	0.01
VRDUSD	Vte rgl t différé	-43,595.	USD	0.91911756	30/06/23	0.92030186			-40,068.93	-40,120.56	0.00	-51.63	0.00
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</b>													

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

V A L E U R	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<-----> PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	>-----> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
					CUMUL (EUR)			92,987.78	92,679.00	0.00	-308.78	0.01
<b>Règlements différés</b>												
					CUMUL (EUR)			-11,235,451.79	-11,235,760.57	0.00	-308.78	-0.63
<b>Coupons et dividendes en espèces</b>												
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>												
DE0001135481	ALLEMAGNE 2.5% 2044	3,000,000,000.	P EUR	0.00025	30/06/23			750,000.00	750,000.00	0.00	0.00	0.04
FI4000046545	FINLAND 2.625% 07/42	20,000.	P EUR	26.25	30/06/23			525,000.00	525,000.00	0.00	0.00	0.03
FR0013346814	ALTA 2.875 07-25	93.	P EUR	2875.	30/06/23			267,375.00	267,375.00	0.00	0.00	0.01
FR0013430840	UMG GRO 1.625 07-29	80.	P EUR	1625.	30/06/23			130,000.00	130,000.00	0.00	0.00	0.01
XS2021993212	UNIC 1.625 07-25	8,000.	P EUR	16.25	30/06/23			130,000.00	130,000.00	0.00	0.00	0.01
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>												
					CUMUL (EUR)			1,802,375.00	1,802,375.00	0.00	0.00	0.10
<b>Frais de gestion</b>												
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>												
FGPVFC1EUR	Frais de Gest. Fixe	-315,211.42	EUR	1.	30/06/23	1.		-315,211.42	-315,211.42	0.00	0.00	-0.02
FGPVFC2EUR	Frais de Gest. Fixe	-25,659.37	EUR	1.	30/06/23	1.		-25,659.37	-25,659.37	0.00	0.00	0.00
FGPVFC3EUR	Frais de Gest. Fixe	-243,689.87	EUR	1.	30/06/23	1.		-243,689.87	-243,689.87	0.00	0.00	-0.01
FGPVFC4EUR	Frais de Gest. Fixe	-76.49	EUR	1.	30/06/23	1.		-76.49	-76.49	0.00	0.00	0.00
FGPVFC5EUR	Frais de Gest. Fixe	-500.24	EUR	1.	30/06/23	1.		-500.24	-500.24	0.00	0.00	0.00
FGPVFC6EUR	Frais de Gest. Fixe	-6,373.2	EUR	1.	30/06/23	1.		-6,373.20	-6,373.20	0.00	0.00	0.00
FGPVFC7EUR	Frais de Gest. Fixe	-0.81	EUR	1.	30/06/23	1.		-0.81	-0.81	0.00	0.00	0.00
FGPVFC8EUR	Frais de Gest. Fixe	-83,033.92	EUR	1.	30/06/23	1.		-83,033.92	-83,033.92	0.00	0.00	0.00
FGPVFC9EUR	Frais de Gest. Fixe	-2,141.58	EUR	1.	30/06/23	1.		-2,141.58	-2,141.58	0.00	0.00	0.00
FGPVFCAEUR	Frais de Gest. Fixe	-7,102.1	EUR	1.	30/06/23	1.		-7,102.10	-7,102.10	0.00	0.00	0.00
FGPVFCBEUR	Frais de Gest. Fixe	-10,586.12	EUR	1.	30/06/23	1.		-10,586.12	-10,586.12	0.00	0.00	0.00
FGPVFD1EUR	Frais de Gest. Fixe	-1,582.83	EUR	1.	30/06/23	1.		-1,582.83	-1,582.83	0.00	0.00	0.00
FGPVFD2EUR	Frais de Gest. Fixe	-11,837.26	EUR	1.	30/06/23	1.		-11,837.26	-11,837.26	0.00	0.00	0.00
FGPVFD3EUR	Frais de Gest. Fixe	-2,223.72	EUR	1.	30/06/23	1.		-2,223.72	-2,223.72	0.00	0.00	0.00
FGPVFD4EUR	Frais de Gest. Fixe	-12,722.96	EUR	1.	30/06/23	1.		-12,722.96	-12,722.96	0.00	0.00	0.00
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>												
					CUMUL (EUR)			-722,741.89	-722,741.89	0.00	0.00	-0.04
<b>Dettes et créances</b>												
					CUMUL (EUR)			-10,155,818.68	-10,156,127.46	0.00	-308.78	-0.57
<b>Disponibilités</b>												
<b>Avoirs en france</b>												
<b>DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE</b>												
BQRCCHF	ROTHSCHILD MM	100,338.45	CHF	1.0190865	30/06/23	1.02165917		102,253.56	102,511.70	0.00	258.14	0.01
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>												
BQRCEUR	ROTHSCHILD MM	9,384,556.91	EUR	1.	30/06/23	1.		9,384,556.91	9,384,556.91	0.00	0.00	0.52
<b>DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING</b>												
BQRCGBP	ROTHSCHILD MM	487,554.16	GBP	1.17702386	30/06/23	1.16512094		573,862.88	568,059.56	0.00	-5,803.32	0.03

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	QUANTITE ET		DEV COT	P.R.U EN DEVISE		DATE	COURS	I F	Devise du portefeuille				PRCT ACT NET	
			EXPR.	QUANTITE		ET EXPR.	COURS				COTA	VALEUR	----->	----->		----->
												VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU	TOTA	PLUS OU MOINS VAL	
<b>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</b>																
BQRCUSD	ROTHSCHILD MM		181,661.16		USD	0.91778578		30/06/23	0.92030186		166,726.03	167,183.10	0.00	457.07	0.01	
<b>Avoirs en france</b>																
											CUMUL (EUR)	10,227,399.38	10,222,311.27	0.00	-5,088.11	0.57
<b>Opérations à terme</b>																
<b>DATE ECHEANCE : 15/09/23</b>																
23164001769	A CHF EUR	15/09/23	128,332.		CHF	1.027		30/06/23	1.02563113		131,798.17	131,621.29	0.00	-176.88	0.01	
	VERSE	15/09/23	-131,798.17		EUR	1.		30/06/23	1.		-131,798.17	-131,798.17	0.00	0.00	-0.01	
23164001770	A CHF EUR	15/09/23	21,448,939.		CHF	1.027		30/06/23	1.02563113		22,028,261.35	21,998,699.53	0.00	-29,561.82	1.22	
	VERSE	15/09/23	-22,028,261.35		EUR	1.		30/06/23	1.		-22,028,261.35	-22,028,261.35	0.00	0.00	-1.23	
23164001771	A CHF EUR	15/09/23	5,671,911.		CHF	1.027		30/06/23	1.02563113		5,825,105.75	5,817,288.48	0.00	-7,817.27	0.32	
	VERSE	15/09/23	-5,825,105.75		EUR	1.		30/06/23	1.		-5,825,105.75	-5,825,105.75	0.00	0.00	-0.32	
23164002131	A USD EUR	15/09/23	909,571.		USD	0.9203		30/06/23	0.91632959		837,044.45	833,466.82	0.00	-3,577.63	0.05	
	VERSE	15/09/23	-837,044.45		EUR	1.		30/06/23	1.		-837,044.45	-837,044.45	0.00	0.00	-0.05	
23164002132	A USD EUR	15/09/23	20,762,799.		USD	0.9203		30/06/23	0.91632959		19,107,233.63	19,025,567.00	0.00	-81,666.63	1.06	
	VERSE	15/09/23	-19,107,233.63		EUR	1.		30/06/23	1.		-19,107,233.63	-19,107,233.63	0.00	0.00	-1.06	
23164003364	A CHF EUR	15/09/23	134,900.		CHF	1.0272		30/06/23	1.02567557		138,572.01	138,363.63	0.00	-208.38	0.01	
	VERSE	15/09/23	-138,572.01		EUR	1.		30/06/23	1.		-138,572.01	-138,572.01	0.00	0.00	-0.01	
23164003396	V USD EUR	15/09/23	41,871.96		EUR	1.		30/06/23	1.		41,871.96	41,871.96	0.00	0.00	0.00	
	VERSE	15/09/23	-45,500.		USD	0.9203		30/06/23	0.91632959		-41,871.96	-41,693.00	0.00	178.96	0.00	
23164003595	V GBP EUR	15/09/23	6,730,482.47		EUR	1.		30/06/23	1.		6,730,482.47	6,730,482.47	0.00	0.00	0.37	
	VERSE	15/09/23	-5,800,000.		GBP	1.1604		30/06/23	1.16153242		-6,730,482.47	-6,736,888.06	0.00	-6,405.59	-0.37	
23172002113	A CHF EUR	15/09/23	257,900.		CHF	1.0235		30/06/23	1.0256163		263,970.53	264,506.44	0.00	535.91	0.01	
	VERSE	15/09/23	-263,970.53		EUR	1.		30/06/23	1.		-263,970.53	-263,970.53	0.00	0.00	-0.01	
23172002119	A USD EUR	15/09/23	20,900.		USD	0.9124		30/06/23	0.91679845		19,069.69	19,161.09	0.00	91.40	0.00	
	VERSE	15/09/23	-19,069.69		EUR	1.		30/06/23	1.		-19,069.69	-19,069.69	0.00	0.00	0.00	
23178001404	V CHF EUR	15/09/23	14,675.76		EUR	1.		30/06/23	1.		14,675.76	14,675.76	0.00	0.00	0.00	
	VERSE	15/09/23	-14,300.		CHF	1.0263		30/06/23	1.02580214		-14,675.76	-14,668.97	0.00	6.79	0.00	
23180001680	A USD EUR	15/09/23	138,000.		USD	0.9166		30/06/23	0.91697218		126,489.46	126,542.16	0.00	52.70	0.01	
	VERSE	15/09/23	-126,489.46		EUR	1.		30/06/23	1.		-126,489.46	-126,489.46	0.00	0.00	-0.01	
23181001781	V USD EUR	15/09/23	108,306.56		EUR	1.		30/06/23	1.		108,306.56	108,306.56	0.00	0.00	0.01	
	VERSE	15/09/23	-118,000.		USD	0.9179		30/06/23	0.91691963		-108,306.56	-108,196.52	0.00	110.04	-0.01	
<b>SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 15/09/23</b>																
											CUMUL (EUR)	0.00	-128,438.40	0.00	-128,438.40	-0.01
<b>Disponibilités</b>																
											CUMUL (EUR)	10,227,399.38	10,093,872.87	0.00	-133,526.51	0.56
<b>VIII - TRESORERIE</b>																
											CUMUL (EUR)	71,580.70	-62,254.59	0.00	-133,835.29	

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

V A L E U R	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	Devise du portefeuille				PRCT ACT NET
								<-----> PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL	
<b>PORTEFEUILLE : R-CO CONVICTION CREDIT EURO (1109 )</b>												
					(EUR)			1,907,731,837.40	1,796,549,899.83	21,808,889.00	-111,181,937.57	100.00

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

Portefeuille titres : 1,796,483,716.02 Coupons et dividendes a recevoir : 1,802,375.

Frais de gestion du jour

Frais de Gest. Fixe :	10,525.	EUR
Frais de Gest. Fixe :	887.13	EUR
Frais de Gest. Fixe :	8,145.51	EUR
Frais de Gest. Fixe :	2.54	EUR
Frais de Gest. Fixe :	16.64	EUR
Frais de Gest. Fixe :	214.36	EUR
Frais de Gest. Fixe :	2,779.52	EUR
Frais de Gest. Fixe :	71.11	EUR
Frais de Gest. Fixe :	236.45	EUR
Frais de Gest. Fixe :	353.02	EUR
Frais de Gest. Fixe :	53.28	EUR
Frais de Gest. Fixe :	394.65	EUR
Frais de Gest. Fixe :	74.19	EUR
Frais de Gest. Fixe :	424.57	EUR
Frais de Gest. Fixe :	0.03	EUR

Frais de gestion charge Entreprise

FRAIS MAXIMUM :	10,525.	EUR
FRAIS MAXIMUM :	887.13	EUR
FRAIS MAXIMUM :	8,145.51	EUR
FRAIS MAXIMUM :	2.54	EUR
FRAIS MAXIMUM :	16.64	EUR
FRAIS MAXIMUM :	214.36	EUR
FRAIS MAXIMUM :	0.03	EUR
FRAIS MAXIMUM :	2,779.52	EUR
FRAIS MAXIMUM :	71.11	EUR
FRAIS MAXIMUM :	236.45	EUR
FRAIS MAXIMUM :	353.02	EUR
FRAIS MAXIMUM :	53.28	EUR
FRAIS MAXIMUM :	394.65	EUR
FRAIS MAXIMUM :	74.19	EUR
FRAIS MAXIMUM :	424.57	EUR

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	541,063,277.63	1,272,126.2125	425.32	30.118931284337			433.83	425.32

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

C2	FR0010807107	R-CO	CV	CRED	FEUR	EUR	35,977,073.72	254,176.5153	141.54	2.002717051416	144.37	141.54
C3	FR0010807123	R-CO	CV	CRED	ICEUR	EUR	849,451,880.49	628,582.1849	1,351.38	47.285283500315	1,351.38	1,351.38
C4	FR0011829068	R-CO	CV	CRED	CCHF	EUR	130,597.26	130.0007	1,004.59	0.007273950779	1,024.68	1,004.59
C5	FR0011839877	R-CO	CV	CRED	CUSD	EUR	855,641.06	791.9464	1,080.43	0.047313843329	1,102.04	1,080.43
C6	FR0011839885	R-CO	CV	CRED	ICCHF	EUR	22,354,450.94	21,681.417	1,031.04	1.245071956905	1,051.66	1,010.42
C7	FR0011839893	R-CO	CV	CRED	MEUR	EUR	1,237,001.73	1,232.8445	1,003.37	0.068857835976	1,053.54	1,003.37
C8	FR0011839901	R-CO	CV	CRED	PEUR	EUR	225,447,053.53	214,637.8934	1,050.36	12.549689148811	1,071.37	1,050.36
C9	FR0011839919	R-CO	CV	CRED	PCHF	EUR	5,767,652.97	5,606.4113	1,028.76	0.321242127111	1,049.34	1,028.76
CA	FR0011839927	R-CO	CV	CRED	PUSD	EUR	19,178,752.90	17,216.6009	1,113.97	1.060545747884	1,136.25	1,113.97
CB	FR0013111804	R-CO	CV	CRED	REUR	EUR	10,737,346.01	1,138,793.5604	9.43	0.597715168967	9.43	9.43
D1	FR0010134437	R-CO	CV	CRED	DEUR	EUR	2,739,071.20	10,656.2248	257.04	0.152473658293	262.18	257.04
D2	FR0011418359	R-CO	CV	CRED	IDEUR	EUR	41,155,698.04	449.3669	91,585.96	2.290958316086	93,417.68	91,585.96
D3	FR0012243988	R-CO	CV	CRED	PBEUR	EUR	6,017,202.38	6,992.7793	860.49	0.334952346212	877.70	860.49
D4	FR0013294063	R-CO	CV	CRED	MFEUR	EUR	34,437,199.97	39,771.3829	865.88	1.916974063579	883.20	865.88

Actif net total en EUR : 1,796,549,899.83

C4	CHF	127,828.6	983.29	0.9788	1,002.96	983.29
C6	CHF	21,880,536.58	1,009.18	0.9788	1,029.36	989.
C9	CHF	5,645,378.73	1,006.95	0.9788	1,027.09	1,006.95
C5	USD	929,739.58	1,173.99	1.0866	1,197.47	1,173.99
CA	USD	20,839,632.9	1,210.44	1.0866	1,234.65	1,210.44

Precedente VL en date du 29/06/23 :

C1	R-CO	CV	CRED	CEUR	Prec. VL :	425.01	(EUR)	Variation :	+0.073%
C2	R-CO	CV	CRED	FEUR	Prec. VL :	141.44	(EUR)	Variation :	+0.071%
C3	R-CO	CV	CRED	ICEUR	Prec. VL :	1,350.37	(EUR)	Variation :	+0.075%
C4	R-CO	CV	CRED	CCHF	Prec. VL :	1,004.42	(EUR)	Variation :	+0.017%
C5	R-CO	CV	CRED	CUSD	Prec. VL :	1,072.46	(EUR)	Variation :	+0.743%
C6	R-CO	CV	CRED	ICCHF	Prec. VL :	1,030.85	(EUR)	Variation :	+0.018%
C7	R-CO	CV	CRED	MEUR	Prec. VL :	1,002.62	(EUR)	Variation :	+0.075%
C8	R-CO	CV	CRED	PEUR	Prec. VL :	1,049.58	(EUR)	Variation :	+0.074%
C9	R-CO	CV	CRED	PCHF	Prec. VL :	1,028.58	(EUR)	Variation :	+0.017%
CA	R-CO	CV	CRED	PUSD	Prec. VL :	1,105.79	(EUR)	Variation :	+0.740%
CB	R-CO	CV	CRED	REUR	Prec. VL :	9.42	(EUR)	Variation :	+0.106%
D1	R-CO	CV	CRED	DEUR	Prec. VL :	256.85	(EUR)	Variation :	+0.074%
D2	R-CO	CV	CRED	IDEUR	Prec. VL :	91,517.82	(EUR)	Variation :	+0.074%
D3	R-CO	CV	CRED	PBEUR	Prec. VL :	859.85	(EUR)	Variation :	+0.074%
D4	R-CO	CV	CRED	MFEUR	Prec. VL :	865.24	(EUR)	Variation :	+0.074%

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

Part	Devise	Actif theorique	Valeur li quidative theorique
C1 FR0007008750 R-CO CV CRED CEUR	EUR	541,063,277.63	425.32
C2 FR0010807107 R-CO CV CRED FEUR	EUR	35,977,073.72	141.54
C3 FR0010807123 R-CO CV CRED ICEUR	EUR	849,451,880.49	1,351.38
C4 FR0011829068 R-CO CV CRED CCHF	EUR	130,597.26	1,004.59
C5 FR0011839877 R-CO CV CRED CUSD	EUR	855,641.06	1,080.43
C6 FR0011839885 R-CO CV CRED ICCHF	EUR	22,354,450.94	1,031.04
C7 FR0011839893 R-CO CV CRED MEUR	EUR	1,237,001.73	1,003.37
C8 FR0011839901 R-CO CV CRED PEUR	EUR	225,447,053.53	1,050.36
C9 FR0011839919 R-CO CV CRED PCHF	EUR	5,767,652.97	1,028.76
CA FR0011839927 R-CO CV CRED PUSD	EUR	19,178,752.90	1,113.97
CB FR0013111804 R-CO CV CRED REUR	EUR	10,737,346.01	9.43
D1 FR0010134437 R-CO CV CRED DEUR	EUR	2,739,071.20	257.04
D2 FR0011418359 R-CO CV CRED IDEUR	EUR	41,155,698.04	91,585.96
D3 FR0012243988 R-CO CV CRED PBEUR	EUR	6,017,202.38	860.49
D4 FR0013294063 R-CO CV CRED MFEUR	EUR	34,437,199.97	865.88

Actif theorique total en EUR : 1,796,549,899.83 ( Sens collecte : EQU )

C4	CHF	127,828.6	983.29
C6	CHF	21,880,536.58	1,009.18
C9	CHF	5,645,378.73	1,006.95
C5	USD	929,739.58	1,173.99
CA	USD	20,839,632.9	1,210.44

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

Type reporting : TIBR Revenu taxable pour residents Belges

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

Poids DD : 94.39 Statut DD : 0

Poids DI : 99.39 Statut DI : M

Type reporting : TISF TIS France

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

Poids DD : 98.68 Statut DD : I

Poids DI : 99.19 Statut DI : M

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

Poids DD : 98.68

Poids DI : 99.19

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 1109 R-CO CONVICTION CREDIT EURO

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

## COURS DES DEVICES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente		variation	
Cours CHF en EUR :	1.0216591745	cotation :	30/06/23	0.	1.022181335	cotation :	29/06/23	-0.05108
Cours EUR en CHF :	0.9788	cotation :	30/06/23	0.	0.9783	cotation :	29/06/23	0.05111
Cours EUR en EUR :	1.	cotation :	30/06/23	0.	1.	cotation :	29/06/23	0.
Cours EUR en GBP :	0.85828	cotation :	30/06/23	0.	0.864	cotation :	29/06/23	-0.66204
Cours EUR en USD :	1.0866	cotation :	30/06/23	0.	1.0938	cotation :	29/06/23	-0.65826
Cours GBP en EUR :	1.1651209396	cotation :	30/06/23	0.	1.1574074074	cotation :	29/06/23	0.66645
Cours USD en EUR :	0.920301859	cotation :	30/06/23	0.	0.9142439203	cotation :	29/06/23	0.66262

## COURS INVERSES DES DEVICES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente		
Cours EUR en CHF :	0.9787999999	cotation :	30/06/23	0.	0.9782999999	cotation :	29/06/23
Cours CHF en EUR :	1.0216591744	cotation :	30/06/23	0.	1.0221813349	cotation :	29/06/23
Cours EUR en EUR :	1.	cotation :	30/06/23	0.	1.	cotation :	29/06/23
Cours GBP en EUR :	1.1651209395	cotation :	30/06/23	0.	1.1574074074	cotation :	29/06/23
Cours USD en EUR :	0.920301859	cotation :	30/06/23	0.	0.9142439202	cotation :	29/06/23
Cours EUR en GBP :	0.8582799999	cotation :	30/06/23	0.	0.864	cotation :	29/06/23
Cours EUR en USD :	1.0866	cotation :	30/06/23	0.	1.0937999999	cotation :	29/06/23



# **R-CO CONVICTION CREDIT EURO**

**DOCUMENT D'INFORMATION PÉRIODIQUE AU 30/06/2023**

## ETAT DU PATRIMOINE EN EUR

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier	1 793 030 205,17
b) Avoirs bancaires	10 222 311,27
c) Autres actifs détenus par l'OPC	85 181 520,00
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	1 888 434 036,44
e) Passif	-91 884 136,61
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	1 796 549 899,83

\* Les montants sont signés

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

Action	Type d'action	Actif net par action	Nombre d'actions en circulation	Valeur nette d'inventaire par action
R-CO CONVICTION CREDIT EURO C CHF H en CHF	C	127 828,60	130,0007	983,29
R-CO CONVICTION CREDIT EURO C EUR en EUR	C	541 063 277,63	1 272 126,2125	425,32
R-CO CONVICTION CREDIT EURO C USD H en USD	C	929 739,58	791,9464	1 173,99
R-CO CONVICTION CREDIT EURO D EUR en EUR	D	2 739 071,20	10 656,2248	257,04
R-CO CONVICTION CREDIT EURO F EUR en EUR	C	35 977 073,72	254 176,5153	141,54
R-CO CONVICTION CREDIT EURO IC CHF H en CHF	C	21 880 536,58	21 681,4170	1 009,18
R-CO CONVICTION CREDIT EURO IC EUR en EUR	C	849 451 880,49	628 582,1849	1 351,38
R-CO CONVICTION CREDIT EURO ID EUR en EUR	D	41 155 698,04	449,3669	91 585,96
R-CO CONVICTION CREDIT EURO M EUR en EUR	C	1 237 001,73	1 232,8445	1 003,37
R-CO CONVICTION CREDIT EURO MF EUR en EUR	D	34 437 199,97	39 771,3829	865,88
R-CO CONVICTION CREDIT EURO PB EUR en EUR	D	6 017 202,38	6 992,7793	860,49
R-CO CONVICTION CREDIT EURO P CHF H en CHF	C	5 645 378,73	5 606,4113	1 006,95
R-CO CONVICTION CREDIT EURO P EUR en EUR	C	225 447 053,53	214 637,8934	1 050,36
R-CO CONVICTION CREDIT EURO P USD H en USD	C	20 839 632,90	17 216,6009	1 210,44
R-CO CONVICTION CREDIT EURO R EUR en EUR	C	10 737 346,01	1 138 793,5604	9,43

## ELÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier.  Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	88,34	84,04
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	11,47	10,91
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	0,51	0,48

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

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

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

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Euro	EUR	1 786 058 780,61	99,42	94,58
Livre Sterling	GBP	5 473 950,32	0,30	0,29
Dollar Us	USD	1 497 474,24	0,08	0,08
TOTAL		1 793 030 205,17	99,80	94,95

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

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

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

Pays	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
FRANCE	19,46	18,51
PAYS-BAS	13,51	12,85
ALLEMAGNE	8,72	8,30
ITALIE	6,95	6,61
LUXEMBOURG	6,86	6,52
ESPAGNE	6,81	6,48
ETATS-UNIS	4,69	4,46
BELGIQUE	4,56	4,34
AUTRICHE	4,14	3,94
IRLANDE	4,09	3,89
ROYAUME-UNI	3,79	3,61
PORTUGAL	3,38	3,22
FINLANDE	2,13	2,03
SUEDE	1,73	1,65
REPUBLIQUE TCHEQUE	1,57	1,50
NORVEGE	1,40	1,33
AUSTRALIE	1,31	1,24
SLOVENIE	0,95	0,91
POLOGNE	0,82	0,78
DANEMARK	0,82	0,78
SUISSE	0,61	0,58
MEXIQUE	0,51	0,48
HONGRIE	0,43	0,41
JERSEY	0,35	0,34
CANADA	0,22	0,21
TOTAL	99,80	94,95

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

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

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

Nature d'actifs	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
<b>Organismes de placement collectif</b>		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	0,51	0,48
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE	0,00	0,00
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés	0,00	0,00
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés	0,00	0,00
Autres organismes non européens	0,00	0,00
<b>Autres actifs</b>		
Autres	0,00	0,00
<b>TOTAL</b>	<b>0,51</b>	<b>0,48</b>

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

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

## MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier.  Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	615 922 445,55	173 297 076,76
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.	113 377 661,23	25 480 587,84
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.	345 146 190,44	415 238 512,99

## DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Action	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
<b>Dividendes versés</b>				
26/05/2023	R-CO CONVICTION CREDIT EURO MF EUR	15,33	0,00	15,33
26/05/2023	R-CO CONVICTION CREDIT EURO PB EUR	15,24	0,00	15,24
26/05/2023	R-CO CONVICTION CREDIT EURO ID EUR	1 716,79	0,00	1 716,79
26/05/2023	R-CO CONVICTION CREDIT EURO D EUR	3,86	0,00	3,86
<b>Dividendes à verser</b>				
	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			

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Actions et valeurs assimilées</b>				
<b>Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ESPAGNE</b>				
ABENGOA CL B	EUR	12 706 492	0,00	0,00
ABENGOA SA	EUR	1 228 837	0,00	0,00
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Actions et valeurs assimilées non négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ITALIE</b>				
SFP 2020 CMC DI RAVENNA	EUR	1 342 565	0,00	0,00
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>TOTAL Actions et valeurs assimilées non négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>TOTAL Actions et valeurs assimilées</b>			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>Obligations et valeurs assimilées</b>				
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
ACCENTRO REAL ESTATE AG 3.625% 13-02-26	EUR	5 903 000	3 338 498,19	0,18
ALLEMAGNE 2.5% 04/07/2044	EUR	30 000 000	30 296 700,00	1,69
ALLIANZ SE 2.6% PERP	EUR	7 000 000	4 707 902,40	0,26
BAYER 2.375% 12-11-79	EUR	3 000 000	2 803 767,62	0,15
CECONOMY AG 1.75% 24-06-26	EUR	14 900 000	11 711 297,82	0,65
CMZB 4.0% 23-03-26 EMTN	EUR	10 000 000	9 821 218,31	0,54
CMZB FRANCFORT 6.5% 06-12-32	EUR	5 800 000	5 987 730,11	0,33
CT INVESTMENT 5.5% 15-04-26	EUR	2 500 000	2 362 223,61	0,13
DEUTSCHE BK 10.0% PERP	EUR	2 000 000	2 023 649,13	0,11
DEUTSCHE BK 4.0% 24-06-32 EMTN	EUR	9 000 000	7 944 191,07	0,44
DEUTSCHE BK AUTRE V PERP	EUR	2 600 000	2 144 773,03	0,12
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 4.375% 28-08-26	EUR	15 800 000	16 076 463,21	0,90
DZ BANK AG DEUTSCHE ZENTRALGENOSSENSCH 1.026% 23-09-30	EUR	6 700 000	5 140 897,43	0,29
ENBW ENERGIE BADENWUERTTEMBERG 1.375% 31-08-81	EUR	5 700 000	4 625 293,89	0,26
HAMBURG COMMERCIAL BANK AG 4.875% 17-03-25	EUR	16 900 000	17 084 099,18	0,95
KION GROUP AG 1.625% 24-09-25	EUR	3 900 000	3 702 891,33	0,21
MUNICH RE 1.25% 26-05-41	EUR	3 000 000	2 299 820,90	0,13
SIXT SE 1.75% 09-12-24 EMTN	EUR	5 300 000	5 177 753,68	0,29
VONOVIA SE 5.0% 23-11-30 EMTN	EUR	12 000 000	12 109 475,34	0,68
WUESTENROT WUERTTEMBERGISCHE AG 2.125% 10-09-41	EUR	10 100 000	7 328 369,07	0,41
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>156 687 015,32</b>	<b>8,72</b>
<b>AUSTRALIE</b>				
SYDNEY AIRPORT FINANCE 4.375% 03-05-33	EUR	23 400 000	23 472 217,13	1,31
<b>TOTAL AUSTRALIE</b>			<b>23 472 217,13</b>	<b>1,31</b>
<b>AUTRICHE</b>				
AUST GOVE BON 3.15% 20-06-44	EUR	20 000 000	20 333 098,36	1,13
BAWAG GROUP 5.0% PERP	EUR	2 400 000	1 936 834,43	0,11
ERSTE GR BK 0.875% 22-05-26	EUR	4 000 000	3 659 432,02	0,20
ERSTESTEIERMAERKISCHE BANKA DD 0.75% 06-07-28	EUR	19 400 000	16 007 500,74	0,89



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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
IMMOFINANZ AG 2.5% 15-10-27	EUR	4 500 000	3 734 843,42	0,21
POSAV 5.375% PERP	EUR	7 400 000	6 798 783,45	0,37
RAIFFEISEN BANK INTL AG 1.5% 12-03-30	EUR	5 000 000	4 332 535,66	0,25
RAIFFEISEN BANK INTL AG 4.125% 08-09-25	EUR	4 300 000	4 387 036,71	0,25
RAIFFEISEN BANK INTL AG 7.375% 20-12-32	EUR	3 700 000	3 827 530,64	0,21
UNIQA INSURANCE 6.875% 31/07/2043	EUR	200 000	213 059,88	0,01
UNIQ VERS AG 6.0% 27-07-46	EUR	200 000	212 246,84	0,01
VOLKSBANK WIEN AG SVP 0.875% 23-03-26	EUR	10 200 000	9 018 252,80	0,50
<b>TOTAL AUTRICHE</b>			<b>74 461 154,95</b>	<b>4,14</b>
<b>BELGIQUE</b>				
AGEAS NV 3.875% PERP	EUR	8 000 000	5 816 247,87	0,33
AGEAS NV EX FORTIS 1.875% 24-11-51	EUR	6 200 000	4 590 474,48	0,26
ALIAxis FINANCE 0.875% 08-11-28	EUR	12 000 000	9 654 905,75	0,53
CRELAN 5.375% 31-10-25 EMTN	EUR	13 000 000	13 411 788,36	0,75
ETHIAS VIE 5.0% 14-01-26	EUR	7 100 000	7 302 667,07	0,41
GROUPE BRUXELLES LAMBERT 4.0% 15-05-33	EUR	20 000 000	20 276 289,62	1,12
KBC GROUPE 4.25% PERP	EUR	5 800 000	5 066 964,31	0,28
VGP 1.5% 08-04-29	EUR	8 100 000	5 660 649,15	0,32
VGP 1.625% 17-01-27	EUR	12 400 000	10 142 573,21	0,56
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>81 922 559,82</b>	<b>4,56</b>
<b>CANADA</b>				
FAIRFAX FINANCIAL 2.75% 29-03-28	EUR	4 300 000	3 908 004,48	0,22
<b>TOTAL CANADA</b>			<b>3 908 004,48</b>	<b>0,22</b>
<b>DANEMARK</b>				
TDC NET AS 5.056% 31-05-28	EUR	14 950 000	14 764 946,37	0,82
<b>TOTAL DANEMARK</b>			<b>14 764 946,37</b>	<b>0,82</b>
<b>ESPAGNE</b>				
ABANCA CORPORACION BANCARIA 5.25% 14-09-28	EUR	6 400 000	6 563 160,55	0,36
ABANCA CORPORACION BANCARIA 5.5% 18-05-26	EUR	15 000 000	15 022 392,62	0,83
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
ADIF ALTA VELOCIDAD 3.9% 30-04-33	EUR	23 000 000	23 450 245,74	1,30
BANCO DE BADELL 2.625% 24-03-26	EUR	7 000 000	6 712 059,02	0,38
BANCO DE BADELL 5.25% 07-02-29	EUR	1 300 000	1 302 923,49	0,07
BANCO NTANDER 1.625% 22-10-30	EUR	5 000 000	4 052 338,70	0,23
BANCO NTANDER 5.75% 23-08-33	EUR	20 100 000	20 112 189,41	1,12
BBVA 4.625% 13-01-31	EUR	14 700 000	15 020 967,45	0,84
CELLNEX FINANCE 1.25% 15-01-29	EUR	9 400 000	7 859 499,03	0,43
CELLNEX FINANCE 2.25% 12-04-26	EUR	5 000 000	4 719 462,30	0,26
LAR ESPANA REAL ESTATE SOCOMI 1.75% 22-07-26	EUR	4 200 000	3 618 791,34	0,20
MAPFRE 2.875% 13-04-30	EUR	8 000 000	6 942 530,05	0,39
MAPFRE SA 4.375% 31-03-47	EUR	5 000 000	4 810 429,37	0,27
WERFENLIFE 0.5% 28-10-26	EUR	2 500 000	2 200 952,40	0,13
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>122 387 941,47</b>	<b>6,81</b>
<b>ETATS-UNIS</b>				
APPLE 0.5% 15-11-31	EUR	6 665 000	5 407 743,62	0,30
BOOKING 4.125% 12-05-33	EUR	17 800 000	17 836 282,82	0,99

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CELANESE US HOLDINGS LLC 4.777% 19-07-26	EUR	8 700 000	8 898 158,59	0,50
CORNING 3.875% 15-05-26	EUR	18 350 000	18 244 463,94	1,01
EURONET WORLDWIDE 1.375% 22-05-26	EUR	9 600 000	8 705 380,20	0,49
HARLEY DAVIDSON FINANCIAL SERVICE 5.125% 05-04-26	EUR	16 325 000	16 686 149,14	0,93
PPG INDUSTRIES 2.75% 01-06-29	EUR	9 000 000	8 426 740,57	0,46
<b>TOTAL ETATS-UNIS</b>			<b>84 204 918,88</b>	<b>4,68</b>
<b>FINLANDE</b>				
CITYCON OYJ 4.496% PERP	EUR	1 900 000	1 268 306,06	0,07
FINLANDE 2.625% 07/42	EUR	20 000 000	18 834 700,00	1,05
FINNAIR 4.25% 19-05-25	EUR	5 000 000	4 708 587,50	0,26
Industrial Power Corporation 4.75% 01-06-30	EUR	10 000 000	10 055 727,87	0,56
TEOLLISUUDEN VOIMA OY 1.125% 09-03-26	EUR	3 700 000	3 387 299,35	0,19
<b>TOTAL FINLANDE</b>			<b>38 254 620,78</b>	<b>2,13</b>
<b>FRANCE</b>				
AGRIPOLE 5.0% 27-11-19	EUR	1 800 000	0,00	0,00
AIR FR KLM 1.875% 16-01-25	EUR	7 500 000	7 117 848,80	0,40
AIR FR KLM 8.125% 31-05-28	EUR	8 800 000	9 197 300,77	0,52
ALD 4.0% 05-07-27 EMTN	EUR	4 000 000	4 120 741,64	0,23
ALD 4.25% 18-01-27 EMTN	EUR	8 000 000	8 136 441,64	0,46
ALTAREA COGEDIM 1.875% 17-01-28	EUR	4 000 000	3 271 260,55	0,18
ALTAREIT 2.875% 02-07-25	EUR	9 300 000	8 632 884,07	0,49
APICIL PREVOYANCE 4.0% 24-10-29	EUR	7 900 000	7 307 073,62	0,40
ATOS SE ZCP 06-11-24 CV	EUR	5 200 000	4 565 912,00	0,25
AUCHAN 2.875% 29-01-26 EMTN	EUR	5 800 000	5 601 858,49	0,31
BFCM 2.375% 24-03-26 EMTN	EUR	10 000 000	9 569 088,52	0,53
BFCM BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL 0.25% 19-07-28	EUR	15 000 000	12 238 458,90	0,68
BNP PAR 6.875% PERP	EUR	13 200 000	12 764 262,23	0,71
BNP PAR CARDIF 1.0% 29-11-24	EUR	2 600 000	2 492 308,53	0,13
BPCE 1.5% 13-01-42	EUR	8 800 000	7 485 090,74	0,41
BQ POSTALE 3.0% PERP	EUR	10 000 000	6 675 234,78	0,37
CA 7.25% PERP EMTN	EUR	6 100 000	6 097 145,93	0,34
CCR RE 2.875% 15-07-40	EUR	3 000 000	2 474 275,68	0,14
CLARIANE 4.125% PERP	GBP	5 800 000	5 473 950,32	0,30
CNP ASSURANCES 1.25% 27-01-29	EUR	5 000 000	4 170 479,79	0,23
COVIVIO HOTELS SCA 1.0% 27-07-29	EUR	3 600 000	2 929 715,51	0,17
CREDIT LOGEMENT 1.35% 28-11-29	EUR	7 800 000	7 347 740,51	0,41
CREDIT MUTUEL ARKEA 1.875% 25-10-29	EUR	5 000 000	4 818 701,03	0,27
CREDIT MUTUEL ARKEA 3.875% 22-05-28	EUR	10 300 000	10 276 388,23	0,57
EDF 2.625% PERP	EUR	12 200 000	9 903 799,00	0,55
EDF 4.0% PERP	EUR	5 000 000	5 014 589,04	0,28
ERAMET 5.875% 21-05-25	EUR	10 300 000	10 582 970,27	0,58
FAURECIA 7.25% 15-06-26	EUR	2 000 000	2 091 312,78	0,12
FINANCIERE APSYS 7.0% 06-10-27	EUR	2 400 000	2 596 302,25	0,14
GROUPAMA ASSURANCES MUTUELLES SA 6.0% 23-01-27	EUR	8 700 000	9 365 072,69	0,53
GROUPAMA ASSURANCES MUTUELLES SA 6.375% PERP	EUR	1 200 000	1 212 503,61	0,07
HERAEUS FINANCE 2.625% 09-06-27	EUR	15 100 000	14 221 527,80	0,79
HOLDING D INFRASTRUCTURES DES METIERS 4.5% 06-04-27	EUR	8 750 000	8 726 704,20	0,49

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
HOLDING INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT 4.25% 18-03-30	EUR	5 300 000	5 356 263,99	0,30
ICADE SANTE SAS 1.375% 17-09-30	EUR	2 000 000	1 555 739,32	0,08
IM GROUP SAS 8.0% 01-03-28	EUR	7 600 000	6 984 708,22	0,39
IPSOS 2.875% 21-09-25	EUR	3 000 000	2 949 367,19	0,16
JC DECAUX SE 5.0% 11-01-29	EUR	12 800 000	13 172 231,89	0,73
LA FINANCIERE ATALIAN 4.0% 15-05-24	EUR	3 300 000	2 481 037,17	0,14
MERCIALYS 2.5% 28-02-29	EUR	9 800 000	8 112 896,26	0,45
MUTU ASSU DES 3.916% 06-10-49	EUR	500 000	499 822,48	0,03
MUTUELLE ASSUR DES COMMERC ET IND FR 0.625% 21-06-27	EUR	10 900 000	9 324 535,74	0,52
ORANO 5.375% 15-05-27 EMTN	EUR	6 600 000	6 809 569,11	0,38
ORPEA 2.625% 10-03-25 EMTN	EUR	10 000 000	3 116 196,72	0,18
QUADIENT 2.25% 03-02-25	EUR	2 800 000	2 687 169,01	0,15
SG 1.125% 30-06-31 EMTN	EUR	5 300 000	4 604 231,64	0,26
SOCIETE GENERALE	EUR	5 000 000	4 455 410,96	0,24
TDF INFRASTRUCTURE SAS 1.75% 01-12-29	EUR	6 000 000	4 910 029,32	0,28
TECHNIP ENERGIES NV 1.125% 28-05-28	EUR	16 325 000	13 987 052,59	0,78
TIKEHAU CAPITAL 2.25% 14-10-26	EUR	8 700 000	8 156 705,26	0,46
TOTALENERGIES SE 1.75% PERP	EUR	8 000 000	7 788 808,74	0,43
TOTALENERGIES SE FR 2.0% PERP	EUR	4 250 000	3 729 618,50	0,21
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	EUR	10 000 000	7 728 801,64	0,43
UNIBAIL RODAMCO SE 2.125% PERP	EUR	16 800 000	14 631 560,71	0,81
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>349 520 700,38</b>	<b>19,46</b>
<b>HONGRIE</b>				
RAIFFEISEN BANK RT BUDAPEST 8.75% 22-11-25	EUR	7 100 000	7 710 306,27	0,43
<b>TOTAL HONGRIE</b>			<b>7 710 306,27</b>	<b>0,43</b>
<b>IRLANDE</b>				
AIB GROUP 2.875% 30-05-31 EMTN	EUR	9 400 000	8 561 936,58	0,48
BK IRELAND 1.375% 11-08-31	EUR	3 300 000	2 910 661,03	0,16
BK IRELAND 2.375% 14-10-29	EUR	3 200 000	3 110 425,64	0,17
DELL BANK INTL DAC 4.5% 18-10-27	EUR	12 650 000	13 182 520,81	0,74
GE CAP EU 3.65% 23-08-32 EMTN	EUR	5 300 000	5 336 702,50	0,30
GRENKE FINANCE 3.95% 09-07-25	EUR	7 100 000	7 068 468,22	0,40
GRENKE FINANCE 4.125% 14-10-24	EUR	8 350 000	8 438 114,23	0,47
PART IREL FIN 1.25% 15-09-26	EUR	6 100 000	5 614 135,00	0,31
PERMANENT TSB GROUP 6.625% 30-06-29	UNKNO WN_CU RRENC Y	0,00	0,00	0,00
SECURITAS TREASURY IRELAND DAC 4.25% 04-04-27	EUR	15 000 000	15 102 254,10	0,84
ZURICH FINANCE IRELAND DESIGNATED 1.875% 17-09-50	EUR	5 000 000	4 082 611,30	0,22
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>73 407 829,41</b>	<b>4,09</b>
<b>ITALIE</b>				
ANIMA 1.5% 22-04-28	EUR	5 450 000	4 664 692,08	0,26
AUTOSTRAD PER L ITALILIA 2.0% 04-12-28	EUR	4 000 000	3 550 925,75	0,20
AZIMUT 1.625% 12-12-24	EUR	4 550 000	4 418 037,22	0,24
BANCA MEDIOLANUM 5.035% 22-01-27	EUR	8 300 000	8 577 718,57	0,48
BANCO BPM 3.375% 19-01-32	EUR	7 000 000	6 231 465,21	0,35
BANCO BPM 6.5% PERP	EUR	1 500 000	1 413 459,94	0,07

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CASSA CENTRALE RAIFFEISEN DELLALTO ADIG 5.885% 16-02-27	EUR	11 750 000	12 035 232,86	0,67
CMC RAVENNA 2.0% 31-12-26	EUR	671 283	0,00	0,00
CREDITO EMILIANO 1.125% 19-01-28	EUR	11 000 000	9 819 055,82	0,55
ENEL 6.375% PERP EMTN	EUR	5 400 000	5 607 236,47	0,31
ENI 2.0% PERP	EUR	7 550 000	6 444 988,19	0,36
ENI 2.625% PERP	EUR	5 000 000	4 680 549,32	0,26
INFRASTRUTTURE WIRELESS ITALIANE 1.625% 20-10-28	EUR	4 450 000	3 972 814,31	0,22
INTE 1.0% 19-11-26 EMTN	EUR	20 000 000	18 112 283,56	1,01
INTE 6.375% PERP	EUR	7 600 000	6 737 365,30	0,38
MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ 0.75% 02-11-28	EUR	9 400 000	7 922 401,77	0,44
MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ 1.125% 23-04-25	EUR	2 300 000	2 174 956,16	0,12
UNICREDIT 1.625% 03-07-25 EMTN	EUR	8 000 000	7 770 115,19	0,43
UNICREDIT 2.731% 15-01-32	EUR	5 400 000	4 796 062,52	0,27
UNICREDIT 4.875% 20-02-29 EMTN	EUR	1 000 000	1 013 177,26	0,06
UNICREDIT 5.375% PERP	EUR	2 000 000	1 843 555,19	0,10
UNICREDIT 5.85% 15-11-27 EMTN	EUR	2 850 000	3 026 923,12	0,17
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>124 813 015,81</b>	<b>6,95</b>
<b>JERSEY</b>				
ATRIUM EUROPEAN REAL ESTATE 3.0% 11-09-25	EUR	5 000 000	4 502 968,84	0,25
ATRIUM EUROPEAN REAL ESTATE 3.625% PERP	EUR	5 000 000	1 843 071,23	0,11
<b>TOTAL JERSEY</b>			<b>6 346 040,07</b>	<b>0,36</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
ACEF HOLDING SCA 0.75% 14-06-28	EUR	4 350 000	3 562 997,29	0,19
ARCELLOR MITTAL 1.75% 19-11-25	EUR	3 000 000	2 882 425,68	0,16
ARCELLOR MITTAL 4.875% 26-09-26	EUR	9 700 000	10 268 718,97	0,57
BANQUE INTLE A LUXEMBOURG 1.75% 18-08-31	EUR	3 000 000	2 703 052,40	0,15
BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS 1.25% 26-04-27	EUR	10 000 000	8 023 065,57	0,45
CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE 1.75% 12-09-25	EUR	10 000 000	9 682 788,36	0,54
CZECH GAS NETWORKS SA RL 0.45% 08-09-29	EUR	13 302 000	10 315 119,72	0,57
LOGICOR FINANCING SARL 0.875% 14-01-31	EUR	4 900 000	3 316 047,14	0,19
LOGICOR FINANCING SARL 1.625% 15-07-27	EUR	3 500 000	2 968 630,96	0,17
NESTLE FIN 3.75% 13-03-33 EMTN	EUR	25 000 000	26 195 821,72	1,46
SELP FINANCE SARL 1.5% 20-12-26	EUR	3 700 000	3 302 212,24	0,19
TRAFIGURA FUNDING 3.875% 02-02-26	EUR	20 000 000	19 187 439,73	1,06
TRATON FINANCE LUXEMBOURG 4.0% 16-09-25	EUR	14 100 000	14 016 808,07	0,78
UMG GROUPE VYV 1.625% 02-07-29	EUR	8 000 000	6 773 470,38	0,38
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>123 198 598,23</b>	<b>6,86</b>
<b>MEXIQUE</b>				
NEMAK SAB CV 2.25% 20-07-28	EUR	10 900 000	9 098 760,82	0,50
<b>TOTAL MEXIQUE</b>			<b>9 098 760,82</b>	<b>0,50</b>
<b>NORVEGE</b>				
AKER BP A 1.125% 12-05-29 EMTN	EUR	6 000 000	5 010 834,59	0,28
VAR ENERGI A 5.5% 04-05-29	EUR	20 000 000	20 144 333,33	1,12
<b>TOTAL NORVEGE</b>			<b>25 155 167,92</b>	<b>1,40</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
ACHMEA BV 4.625% PERP	EUR	5 800 000	4 590 957,20	0,25
ARCADIS NV 4.875% 28-02-28	EUR	13 800 000	14 041 275,99	0,78

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ASR NEDERLAND NV 5.0% PERP	EUR	6 000 000	6 138 391,23	0,35
ATRIUM FINANCE ISSUER BV 2.625% 05-09-27	EUR	1 500 000	1 126 521,27	0,06
CETIN FINANCE BV 3.125% 14-04-27	EUR	13 900 000	12 961 555,17	0,72
CITYCON TREASURY BV 1.625% 12-03-28	EUR	3 000 000	2 208 094,43	0,12
COOPERATIEVE RABOBANK UA 4.0% 10-01-30	EUR	17 100 000	17 129 208,21	0,95
COOPERATIEVE RABOBANK UA 4.375% PERP	EUR	5 000 000	4 379 863,39	0,24
COOPERATIEVE RABOBANK UA 4.875% PERP	EUR	4 200 000	3 538 462,13	0,20
DIGITAL DUTCH FINCO BV 0.625% 15-07-25	EUR	1 800 000	1 649 369,96	0,09
EASYJET FINCO BV 1.875% 03-03-28	EUR	14 750 000	12 996 906,89	0,72
ENEL FINANCE INTL NV 0.0% 17-06-27	EUR	15 000 000	12 895 575,00	0,71
FERROVIAL NETHERLANDS BV 2.124% PERP	EUR	7 643 000	7 639 863,86	0,43
ING GROEP NV 1.25% 16-02-27	EUR	2 000 000	1 841 472,05	0,10
JAB HOLDINGS BV 1.0% 20-12-27	EUR	2 400 000	2 107 007,67	0,12
NATURGY FINANCE BV 2.374% PERP	EUR	12 000 000	10 696 864,60	0,59
NE PROPERTY BV 3.375% 14-07-27	EUR	5 000 000	4 659 376,71	0,26
NETH GOVE 3.75% 15-01-42	EUR	30 000 000	34 954 372,60	1,95
NEW EUROPE PROPERTY COOPERATIF 1.75% 23-11-24	EUR	7 563 000	7 268 358,99	0,41
NIBC BANK NV 2.0% 09-04-24	EUR	1 900 000	1 866 511,46	0,11
NIBC BANK NV 6.0% PERP	EUR	3 200 000	2 529 903,21	0,14
OCI NV 3.625% 15-10-25	EUR	15 000 000	13 238 300,63	0,74
PPF ARENA 2.125% 31-01-25 EMTN	EUR	7 400 000	7 187 810,58	0,40
PPF ARENA 3.5% 20-05-24 EMTN	EUR	3 350 000	3 364 482,98	0,18
PROSUS NV 1.207% 19-01-26 EMTN	EUR	6 050 000	5 548 511,69	0,31
PROSUS NV 2.085% 19-01-30	EUR	7 400 000	5 871 067,25	0,33
VAN LANSCHOT KEMPEN WEALTH MANAGEMENT NV 6.75% PERP	EUR	5 200 000	4 968 223,00	0,28
VITERRA FINANCE BV 1.0% 24-09-28	EUR	8 400 000	7 162 792,77	0,40
WINTERSHALL DEA SCHWEIZ BV 0.84% 25-09-25	EUR	18 100 000	16 797 250,02	0,94
WIZZ AIR FINANCE CO BV 1.0% 19-01-26	EUR	12 700 000	11 286 717,90	0,63
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>242 645 068,84</b>	<b>13,51</b>
<b>POLOGNE</b>				
MBANK 0.966% 21-09-27 EMTN	EUR	4 100 000	3 238 586,74	0,18
PKO BANK POLSKI 5.625% 01-02-26	EUR	11 200 000	11 490 010,19	0,64
<b>TOTAL POLOGNE</b>			<b>14 728 596,93</b>	<b>0,82</b>
<b>PORTUGAL</b>				
BCP 8.5% 25-10-25 EMTN	EUR	7 000 000	7 656 214,52	0,43
CAIXA CENTRAL DE CREDITO AGRICOLA MUTUO 8.375% 04-07-27	EUR	12 000 000	12 019 200,00	0,67
GALP GAS NATURAL DISTRIBUICAO 4.875% 03-07-28	EUR	18 300 000	18 306 829,50	1,01
NOVO BAN 3.5% 23-07-24	EUR	8 000 000	8 250 744,66	0,45
NOVO BAN 9.875% 01-12-33	EUR	14 000 000	14 577 613,15	0,82
<b>TOTAL PORTUGAL</b>			<b>60 810 601,83</b>	<b>3,38</b>
<b>REPUBLIQUE TCHEQUE</b>				
CE ENERGY AS 1.659% 26-04-24	EUR	17 000 000	16 269 299,59	0,91
CESKA SPORITELNA AS 5.943% 29-06-27	EUR	12 000 000	12 020 842,62	0,67
<b>TOTAL REPUBLIQUE TCHEQUE</b>			<b>28 290 142,21</b>	<b>1,58</b>
<b>ROYAUME-UNI</b>				
3I GROUP 4.875% 14-06-29	EUR	17 500 000	17 326 906,35	0,97
BP CAP MK 3.25% PERP	EUR	6 400 000	5 924 643,67	0,33

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BRITISH AMERICAN TOBAC 3.0% PERP	EUR	13 000 000	11 133 255,21	0,62
CRED SUIS SA AG LONDON BRANCH 0.25% 05-01-26	EUR	10 800 000	9 670 999,07	0,53
CRED SUIS SA AG LONDON BRANCH 5.5% 20-08-26	EUR	5 000 000	5 185 633,90	0,29
HSBC 3.019% 15-06-27	EUR	8 000 000	7 639 817,92	0,43
INTL PERSONAL FINANCE 9.75% 12-11-25	EUR	5 185 000	4 941 288,66	0,27
RENTOKIL INITIAL FINANCE BV 3.875% 27-06-27	EUR	4 800 000	4 776 197,38	0,26
TECHNIPFMC 6.5% 01-02-26	USD	1 598 000	1 497 474,24	0,09
<b>TOTAL ROYAUME-UNI</b>			<b>68 096 216,40</b>	<b>3,79</b>
<b>SLOVENIE</b>				
NOVA KREDITNA BANKA MARIBOR DD 1.875% 27-01-25	EUR	9 100 000	8 883 069,09	0,49
NOVA LJUBLJANSKA BANKA DD 6.0% 19-07-25	EUR	7 800 000	8 242 644,12	0,46
<b>TOTAL SLOVENIE</b>			<b>17 125 713,21</b>	<b>0,95</b>
<b>SUEDE</b>				
AB SAGAX 2.0% 17-01-24	EUR	6 600 000	6 523 740,16	0,36
CASTELLUM AB 0.75% 04-09-26	EUR	2 000 000	1 660 542,05	0,09
FASTIGHETS AB BALDER 1.125% 29-01-27	EUR	7 800 000	5 922 331,11	0,33
HEIMSTADEN AB 4.25% 09-03-26	EUR	1 600 000	892 530,22	0,05
HEIMSTADEN AB 4.375% 06-03-27	EUR	4 800 000	3 196 897,33	0,18
HEIMSTADEN AB 6.75% PERP	EUR	4 700 000	2 169 018,77	0,12
INTRUM AB 9.25% 15-03-28	EUR	12 300 000	10 768 721,53	0,60
<b>TOTAL SUEDE</b>			<b>31 133 781,17</b>	<b>1,73</b>
<b>SUISSE</b>				
JULIUS BAER GRUPPE AG 6.625% PERP	EUR	3 600 000	3 223 128,73	0,17
ZURCHER KANTONALBANK 2.02% 13-04-28	EUR	8 400 000	7 663 157,74	0,43
<b>TOTAL SUISSE</b>			<b>10 886 286,47</b>	<b>0,60</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>1 793 030 205,17</b>	<b>99,80</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées</b>			<b>1 793 030 205,17</b>	<b>99,80</b>
<b>Organismes de placement collectif</b>				
<b>OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>				
<b>FRANCE</b>				
R-CO 4CHANGE NET ZERO CREDIT EURO C	EUR	100 480,7026	3 681 612,94	0,21
R-CO CONVICTION SUBFIN C EUR	EUR	1 000	87 760,00	0,00
R-CO CONVICTION SUBFIN ID EUR	EUR	2 000	1 720 480,00	0,10
R-CO CONVICTION SUBFIN I EUR	EUR	3 665	3 245 100,95	0,18
R-CO TARGET 2028 IG P CHF H	CHF	1 000	100 837,76	0,01
R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES P CHF H	CHF	1 000	104 863,10	0,00
RMM COURT TERME C	EUR	50	198 526,00	0,01
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>9 139 180,75</b>	<b>0,51</b>
<b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>			<b>9 139 180,75</b>	<b>0,51</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>9 139 180,75</b>	<b>0,51</b>
<b>Instrument financier à terme</b>				
<b>Autres instruments financiers à terme</b>				
<b>Credit Default Swap</b>				
ITRAXX EUR XOVER S39	EUR	-70 000 000	-2 881 527,44	-0,16
ITRAXX EUR XOVER S39	EUR	-65 000 000	-2 675 704,06	-0,15
<b>TOTAL Credit Default Swap</b>			<b>-5 557 231,50</b>	<b>-0,31</b>

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TOTAL Autres instruments financiers à terme			-5 557 231,50	-0,31
TOTAL Instrument financier à terme			-5 557 231,50	-0,31
Créances			76 042 339,25	4,24
Dettes			-86 326 905,11	-4,81
Comptes financiers			10 222 311,27	0,57
Actif net			1 796 549 899,83	100,00

Parts R-CO CONVICTION CREDIT EURO C CHF H	CHF	130,0007	983,29
Parts R-CO CONVICTION CREDIT EURO C EUR	EUR	1 272 126,2125	425,32
Parts R-CO CONVICTION CREDIT EURO C USD H	USD	791,9464	1 173,99
Parts R-CO CONVICTION CREDIT EURO D EUR	EUR	10 656,2248	257,04
Parts R-CO CONVICTION CREDIT EURO F EUR	EUR	254 176,5153	141,54
Parts R-CO CONVICTION CREDIT EURO IC CHF H	CHF	21 681,4170	1 009,18
Parts R-CO CONVICTION CREDIT EURO IC EUR	EUR	628 582,1849	1 351,38
Parts R-CO CONVICTION CREDIT EURO ID EUR	EUR	449,3669	91 585,96
Parts R-CO CONVICTION CREDIT EURO M EUR	EUR	1 232,8445	1 003,37
Parts R-CO CONVICTION CREDIT EURO MF EUR	EUR	39 771,3829	865,88
Parts R-CO CONVICTION CREDIT EURO PB EUR	EUR	6 992,7793	860,49
Parts R-CO CONVICTION CREDIT EURO P CHF H	CHF	5 606,4113	1 006,95
Parts R-CO CONVICTION CREDIT EURO P EUR	EUR	214 637,8934	1 050,36
Parts R-CO CONVICTION CREDIT EURO P USD H	USD	17 216,6009	1 210,44
Parts R-CO CONVICTION CREDIT EURO R EUR	EUR	1 138 793,5604	9,43