

R-CO 4CHANGE NET ZERO 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	64 632 688,66
b) Avoirs bancaires	1 165,51
c) Autres actifs détenus par l'OPC	1 353 890,78
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	65 987 744,95
e) Passif	-62 065,46
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	65 925 679,49

(*) Les montants sont signés

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

Part	Type de part	Actif net de la part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
R-CO 4CHANGE NET ZERO CREDIT EURO C EUR en EUR	C	36 401 440,32	939 822,6140	38,73
R-CO 4CHANGE NET ZERO CREDIT EURO D EUR en EUR	D	988 598,20	62 160,8937	15,90
R-CO 4CHANGE NET ZERO CREDIT EURO I CHF H en CHF	C	828 466,75	820,0000	1 010,33
R-CO 4CHANGE NET ZERO CREDIT EURO I EUR en EUR	C	13 178 791,51	90,3999	145 783,25
R-CO 4CHANGE NET ZERO CREDIT EURO P EUR en EUR	C	14 496 596,36	147 095,7398	98,55

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.	89,33	89,25
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.	8,71	8,70
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.	1,93	1,93

(*) 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 DEVISE

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
Euro	EUR	64 632 688,66	98,04	97,95
TOTAL		64 632 688,66	98,04	97,95

(*) 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	30,57	30,54
PAYS-BAS	13,58	13,57
ALLEMAGNE	9,50	9,49
ITALIE	9,32	9,31
ESPAGNE	9,18	9,17
ETATS-UNIS	5,47	5,46
SUEDE	3,33	3,32
LUXEMBOURG	2,75	2,74
BELGIQUE	2,56	2,56
AUTRICHE	1,74	1,74
ROYAUME-UNI	1,74	1,74
IRLANDE	1,65	1,65
DANEMARK	1,60	1,60
NORVEGE	1,52	1,52
FINLANDE	1,47	1,47
AUSTRALIE	0,78	0,78
NOUVELLE-ZELANDE	0,71	0,71
PORTUGAL	0,30	0,30
REPUBLIQUE TCHEQUE	0,27	0,27
TOTAL	98,04	97,95

(*) 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	1,93	1,93
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	1,93	1,93

(*) 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.	5 289 222,98	7 004 027,21
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	1 026 616,00	0,00
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	7 551 333,77	8 598 755,96

DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE

	Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
Dividendes versés				
31/05/2024	R-CO 4CHANGE NET ZERO CREDIT EURO D EUR	0,34	0,00	0,34
Dividendes à verser				
	R-CO 4CHANGE NET ZERO CREDIT EURO D 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
OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES			64 632 688,66	98,04
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			64 632 688,66	98,04
Assurance			2 643 963,20	4,01
ACHMEA BV 4.625% PERP	EUR	400 000	366 533,17	0,56
AGEAS NV EX FORTIS 3.875% PERP	EUR	400 000	341 568,25	0,52
ALLIANZ SE 2.6% PERP	EUR	400 000	303 977,07	0,46
CNPFP 2 3/4 02/05/29	EUR	400 000	385 362,09	0,58
GROUPAMA ASSURANCES MUTUELLES 6.0% 23-01-27	EUR	500 000	537 439,22	0,81
MAPFRE 2.875% 13-04-30	EUR	400 000	374 062,55	0,57
MUNICH RE 1.25% 26-05-41	EUR	400 000	335 020,85	0,51
Banques commerciales			15 221 556,81	23,10
ABANCA CORPORACION BANCARIA 6.0% PERP	EUR	200 000	198 434,59	0,30
AUSTRALIA NEW ZEA BANKING GRP LTD GTO 0.669% 05-05-31	EUR	550 000	514 138,94	0,78
BANCO BPM 4.875% 17-01-30 EMTN	EUR	500 000	522 529,43	0,79
BANCO BPM 6.5% PERP	EUR	200 000	205 239,86	0,31
BANCO DE BADELL 5.125% 10-11-28	EUR	1 000 000	1 075 796,42	1,63
BBVA 3.5% 10-02-27	EUR	400 000	403 137,95	0,61
BBVA 4.375% 14-10-29 EMTN	EUR	600 000	643 660,98	0,98
BELFIUS SANV 0.375% 08-06-27	EUR	600 000	546 483,95	0,83
BNP PAR 0.5% 19-01-30 EMTN	EUR	600 000	516 203,46	0,78
BNP PAR 6.875% PERP	EUR	400 000	410 471,55	0,62
BPCE 4.625% 02-03-30	EUR	500 000	521 221,95	0,79
CA 0.5% 21-09-29 EMTN	EUR	500 000	437 259,22	0,66
CA 3.0% 02-02-25	EUR	500 000	499 663,91	0,76
CAIXABANK 0.5% 09-02-29 EMTN	EUR	800 000	713 373,77	1,08
CAIXABANK 8.25% PERP	EUR	400 000	427 151,80	0,65
CMZB FRANCFORT 3.0% 14-09-27	EUR	500 000	502 404,71	0,76
CREDIT MUTUEL ARKEA 1.875% 25-10-29	EUR	400 000	401 659,44	0,61
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG AUTRE R+5.383% PERP	EUR	400 000	243 718,20	0,37
DE VOLKSBANK NV 0.375% 03-03-28	EUR	600 000	531 121,89	0,81
HSBC 0.641% 24-09-29	EUR	800 000	707 523,08	1,07
ICCREA BANCA 4.25% 05-02-30	EUR	600 000	611 613,48	0,93
ING GROEP NV 0.875% 09-06-32	EUR	400 000	363 580,55	0,55
INTE 3.928% 15-09-26 EMTN	EUR	300 000	308 767,75	0,47
INTE 4.75% 06-09-27 EMTN	EUR	400 000	426 951,77	0,65
INTE 5.0% 08-03-28 EMTN	EUR	200 000	209 028,08	0,32
NATLENERLANDEN BANK NV 0.5% 21-09-28	EUR	600 000	531 512,07	0,81
RAIFFEISENBANK A S E 1.0% 09-06-28	EUR	200 000	180 761,03	0,27
SOCIETE GENERALE	EUR	400 000	383 849,30	0,58
SYDBANK 5.125% 06-09-28 EMTN	EUR	500 000	538 914,10	0,82
UNICREDIT 2.731% 15-01-32	EUR	200 000	193 271,07	0,29
UNICREDIT 4.3% 23-01-31 EMTN	EUR	300 000	306 682,59	0,47
VOLKSBANK WIEN AG 4.75% 15-03-27	EUR	1 100 000	1 145 429,92	1,75

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Biens de consommation durables			1 161 798,39	1,76
ELECTROLUX AB 2.5% 18-05-30	EUR	600 000	558 385,32	0,85
NE PROPERTY BV 3.375% 14-07-27	EUR	600 000	603 413,07	0,91
Boissons			467 316,23	0,71
COCA COLA HBC FINANCE BV 1.0% 14-05-27	EUR	500 000	467 316,23	0,71
Composants automobiles			776 193,36	1,18
PIRELLI C 4.25% 18-01-28 EMTN	EUR	150 000	154 671,89	0,23
VALEO 5.375% 28-05-27 EMTN	EUR	600 000	621 521,47	0,95
Construction et ingénierie			955 254,98	1,45
FERROVIAL EMISIONES 0.54% 12-11-28	EUR	500 000	443 328,85	0,67
WEBUILD 3.875% 28-07-26	EUR	500 000	511 926,13	0,78
Distribution de produits alimentaires de première nécessité			2 455 608,54	3,72
CARREFOUR 4.125% 12-10-28 EMTN	EUR	700 000	733 693,87	1,10
CECONOMY AG 1.75% 24-06-26	EUR	500 000	481 814,28	0,73
INMOBILIARIA COLONIAL 1.45% 28-10-24	EUR	300 000	300 495,04	0,46
METRO AG 1.5% 19-03-25 EMTN	EUR	400 000	395 074,03	0,60
TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES 0.375% 27-07-29	EUR	400 000	342 959,54	0,52
WORLDLINE 1.625% 13-09-24	EUR	200 000	201 571,78	0,31
Electricité			2 694 833,94	4,09
EDF 1.0% 29-11-33 EMTN	EUR	400 000	308 596,66	0,47
ENERGIAS DE PORTUGAL EDP 1.7% 20-07-80	EUR	200 000	198 013,79	0,30
RTE EDF TRANSPORT 3.75% 04-07-35	EUR	800 000	826 124,07	1,25
TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE 2.375% PERP	EUR	400 000	373 667,70	0,57
VATFAL 0 1/2 06/24/26	EUR	500 000	471 944,79	0,72
VATTENFALL AB 0.125% 12-02-29	EUR	600 000	516 486,93	0,78
Emballage et conditionnement			196 261,61	0,30
SIG COMBIBLOC PURCHASECO SARL 2.125% 18-06-25	EUR	200 000	196 261,61	0,30
Equipements électriques			526 852,64	0,80
NEXANS 5.5% 05-04-28	EUR	500 000	526 852,64	0,80
Equipements et fournitures médicaux			547 091,16	0,83
ESSILORLUXOTTICA 0.375% 27-11-27	EUR	600 000	547 091,16	0,83
Finances			600 302,35	0,91
SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 0.5% 22-09-29	EUR	700 000	600 302,35	0,91
FPI Bureautiques			651 945,55	0,99
GECINA 1.375% 26-01-28 EMTN	EUR	700 000	651 945,55	0,99
FPI Soins de Santé			80 959,72	0,12
COFINIMMO 0.875% 02-12-30	EUR	100 000	80 959,72	0,12
Gaz			197 009,59	0,30
REDEXIS GAS FINANCE BV 1.875% 28-05-25	EUR	200 000	197 009,59	0,30
Grands magasins et autres			481 610,70	0,73
PROSUS NV 1.207% 19-01-26 EMTN	EUR	500 000	481 610,70	0,73
Hôtels, restaurants et loisirs			1 180 810,29	1,79
ACCOR 2.375% 29-11-28	EUR	600 000	573 582,84	0,87
BOOKING 3.625% 01-03-32	EUR	600 000	607 227,45	0,92

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Industrie aérospatiale et défense			495 848,60	0,75
MTU AERO ENGINES 3.0% 01-07-25	EUR	500 000	495 848,60	0,75
Infrastructure de transports			613 234,48	0,93
HOLDING INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT 4.25% 18-03-30	EUR	600 000	613 234,48	0,93
Logiciels			1 407 311,47	2,13
GETLINK 3.5% 30-10-25	EUR	400 000	396 909,78	0,60
KION GROUP AG 1.625% 24-09-25	EUR	500 000	493 392,75	0,75
PANDORA AS 4.5% 10-04-28 EMTN	EUR	500 000	517 008,94	0,78
Machines			918 486,20	1,39
SIEMENS FINANCIERINGSMAATNV 3.125% 22-05-32	EUR	300 000	296 587,58	0,45
SIEMENS FINANCIERINGSMAATNV 3.375% 24-08-31	EUR	600 000	621 898,62	0,94
Marchés de capitaux			1 826 570,65	2,77
AIB GROUP 2.875% 30-05-31 EMTN	EUR	500 000	486 179,66	0,74
BANCO NTANDER 1.125% 23-06-27	EUR	600 000	560 878,44	0,85
MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ 4.75% 14-03-28	EUR	750 000	779 512,55	1,18
Matériaux de construction			100 244,22	0,15
IMERYS 2.0% 10-12-24 EMTN	EUR	100 000	100 244,22	0,15
Media			1 471 130,98	2,23
IPSOS 2.875% 21-09-25	EUR	500 000	502 703,65	0,76
JCDECAUX 2.625% 24-04-28	EUR	1 000 000	968 427,33	1,47
Médias			499 605,14	0,76
BERTELSMANN 3.5% 29-05-29	EUR	500 000	499 605,14	0,76
Ordinateurs et périphériques			612 686,66	0,93
IBM INTL BUSINESS MACHINES 3.625% 06-02-31	EUR	600 000	612 686,66	0,93
Papier et industrie du bois			348 598,74	0,53
UPM KYMMENE OY 0.125% 19-11-28	EUR	400 000	348 598,74	0,53
Pétrole et gaz			1 446 939,16	2,19
ERG 0.875% 15-09-31 EMTN	EUR	400 000	322 436,79	0,49
ITALGAS 4.125% 08-06-32 EMTN	EUR	500 000	503 841,16	0,76
NESTE OYJ 4.25% 16-03-33 EMTN	EUR	600 000	620 661,21	0,94
Producteur et commerce d'énergie indépendants			163 847,97	0,25
AIR LIQUIDE 0.375% 27-05-31	EUR	200 000	163 847,97	0,25
Produits alimentaires			613 480,97	0,93
GEN MILLS 3.907% 13-04-29	EUR	600 000	613 480,97	0,93
Produits chimiques			463 787,40	0,70
ARKEMA 0.125% 14-10-26 EMTN	EUR	500 000	463 787,40	0,70
Produits pour l'industrie du bâtiment			474 878,93	0,72
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN 2.625% 10-08-32	EUR	500 000	474 878,93	0,72
Services aux collectivités			4 993 060,19	7,57
ACEA 3.875% 24-01-31 EMTN	EUR	700 000	711 007,42	1,08
DEUTSCHLAND REP 4.75% 04/07/28	EUR	1 300 000	1 471 815,07	2,22
EDP FIN 0.375% 16-09-26 EMTN	EUR	400 000	374 558,52	0,57
EDP FIN 3.875% 11-03-30 EMTN	EUR	300 000	306 940,97	0,47
ENGIE 1.5% PERP	EUR	400 000	357 928,59	0,54

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ENGIE 4.5% 06-09-42 EMTN	EUR	200 000	209 688,05	0,32
IBERDROLA FINANZAS SAU 3.125% 22-11-28	EUR	400 000	404 760,12	0,61
IBERDROLA FINANZAS SAU 3.375% 22-11-32	EUR	500 000	505 119,26	0,77
SUEZ 1.25% 19-05-28 EMTN	EUR	600 000	552 991,11	0,84
VEOLIA ENVIRONNEMENT 1.0% 03-04-25	EUR	100 000	98 251,08	0,15
Services aux entreprises			774 851,44	1,18
INTRUM AB 3.5% 15-07-26 EMTN	EUR	400 000	272 624,44	0,41
LA POSTE 0.0000010% 18-07-29	EUR	600 000	502 227,00	0,77
Services aux professionnels			1 109 341,52	1,68
BURE VERI 2.0% 07-09-26	EUR	400 000	392 807,52	0,60
MAN 1 3/4 06/22/26	EUR	300 000	290 638,34	0,44
TELEPERFORMANCE SE 5.75% 22-11-31	EUR	400 000	425 895,66	0,64
Services clientèle divers			1 229 130,48	1,86
ALD 4.0% 05-07-27 EMTN	EUR	700 000	733 944,49	1,11
EDENRED 3.625% 13-06-31	EUR	500 000	495 185,99	0,75
Services de télécommunication diversifiés			2 708 261,63	4,11
CHORUS 0.875% 05-12-26	EUR	500 000	470 535,25	0,71
KPN 6.0% PERP	EUR	300 000	323 751,98	0,49
ORANGE 0.0% 29-06-26 EMTN	EUR	500 000	467 055,00	0,71
TELENOR AS 0.25% 14-02-28 EMTN	EUR	800 000	716 467,56	1,10
TELENOR AS 0.75% 31-05-26 EMTN	EUR	300 000	285 455,26	0,43
VERIZON COMMUNICATION 4.75% 31-10-34	EUR	400 000	444 996,58	0,67
Services de télécommunication mobile			520 310,24	0,79
AMERICAN TOWER 4.625% 16-05-31	EUR	500 000	520 310,24	0,79
Services financiers diversifiés			7 182 843,36	10,90
ACEF HOLDING SCA 0.75% 14-06-28	EUR	1 000 000	881 294,86	1,33
CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE 1.75% 12-09-25	EUR	300 000	297 426,71	0,45
CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE 1.75% 25-03-27	EUR	100 000	95 841,16	0,15
CTP BV 2.125% 01-10-25 EMTN	EUR	282 000	280 247,80	0,43
DEUTSCHE BOERSE 1.25% 16-06-47	EUR	400 000	369 917,18	0,56
ENEL FINANCE INTL NV 0.375% 17-06-27	EUR	300 000	274 114,23	0,42
ENEL FINANCE INTL NV 0.875% 17-01-31	EUR	400 000	337 976,99	0,51
GROUPE BRUXELLES LAMBERT 4.0% 15-05-33	EUR	700 000	718 413,69	1,09
HARLEY DAVIDSON FINANCIAL SERVICE 5.125% 05-04-26	EUR	500 000	516 493,08	0,78
LEASEPLAN CORPORATION NV 0.25% 07-09-26	EUR	200 000	186 692,47	0,28
LEASEPLAN CORPORATION NV 3.5% 09-04-25	EUR	400 000	402 623,92	0,61
NATURGY FINANCE BV 1.375% 19-01-27	EUR	600 000	572 621,26	0,87
NIBC BANK NV 6.0% PERP	EUR	200 000	202 776,38	0,31
RICHEMONT INTL 1.125% 26-05-32	EUR	400 000	340 530,16	0,52
SIEMENS ENERGY FINANCE BV 4.25% 05-04-29	EUR	500 000	507 210,79	0,77
VESTAS WIND SYSTEMS FINANCE BV 1.5% 15-06-29	EUR	800 000	725 582,90	1,10
VOLVO TREASURY AB 0.0% 18-05-26	EUR	400 000	374 388,00	0,57
WPP FINANCE 2016 1.375% 20-03-25	EUR	100 000	98 691,78	0,15
Services liés aux technologies de l'information			473 779,49	0,72
CAPGEMINI 2.0% 15-04-29	EUR	500 000	473 779,49	0,72
Sociétés d'investissement immobilier cotées (SIIC)			1 954 912,40	2,97
COVIVIO 1.625% 23-06-30	EUR	700 000	613 259,98	0,93

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ICADE 1.0% 19-01-30	EUR	500 000	426 336,60	0,65
ICADE 1.5% 13-09-27	EUR	500 000	472 054,10	0,72
UNIBAIL RODAMCO SE 0.75% 25-10-28	EUR	500 000	443 261,72	0,67
Soins et autres services médicaux			669 588,77	1,02
FRESENIUS MEDICAL CARE AG 1.0% 29-05-26	EUR	400 000	382 148,60	0,58
FRESENIUS SE 1.625% 08-10-27	EUR	300 000	287 440,17	0,44
Textiles, habillement et produits de luxe			720 588,51	1,09
KERING 3.625% 05-09-31 EMTN	EUR	700 000	720 588,51	1,09
TITRES D'OPC			1 272 749,37	1,93
OPCVM			1 272 749,37	1,93
Gestion collective			1 272 749,37	1,93
RMM COURT TERME C	EUR	309	1 272 749,37	1,93
Total			65 905 438,03	99,97

(*) 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 (*)
Total	0,00	0,00		0,00		0,00

(*) 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	5	1 950,00	0,00	582 200,00
EURO BUND 0924	15	5 250,00	0,00	1 974 300,00
Sous-total 1.		7 200,00	0,00	2 556 500,00
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		7 200,00	0,00	2 556 500,00

(*) 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				
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 - 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 de part

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	-424,41	CHF	861 777,78	EUR	-862 202,19	FR001400JCC2
Total	0,00	-424,41		861 777,78		-862 202,19	

(*) 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)	65 905 438,03
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	0,00
Total instruments financiers à terme - actions	0,00
Total instruments financiers à terme - taux	7 200,00
Total instruments financiers à terme - change	0,00
Total instruments financiers à terme - crédit	0,00
Total instruments financiers à terme - autres expositions	0,00
Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises	-424,41
Autres actifs (+)	75 106,92
Autres passifs (-)	-61 641,05
Passifs de financement (-)	0,00
Total = actif net	65 925 679,49

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part R-CO 4CHANGE NET ZERO CREDIT EURO C EUR	EUR	939 822,6140	38,73
Part R-CO 4CHANGE NET ZERO CREDIT EURO D EUR	EUR	62 160,8937	15,90
Part R-CO 4CHANGE NET ZERO CREDIT EURO I CHF H	CHF	820,0000	1 010,33
Part R-CO 4CHANGE NET ZERO CREDIT EURO I EUR	EUR	90,3999	145 783,25
Part R-CO 4CHANGE NET ZERO CREDIT EURO P EUR	EUR	147 095,7398	98,55