

# **RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE**

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

## RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE

Compartiment de la SICAV :

R-CO

29, avenue de Messine  
75008 Paris

### Attestation du Commissaire aux Comptes relative à la composition de l'actif

au 30 juin 2023

---

En notre qualité de commissaire aux comptes de la SICAV R-CO et en application des dispositions prévues par l'article L 214-17 du Code monétaire et financier relatives au contrôle de la composition de l'actif, nous avons établi la présente attestation sur les informations figurant dans la composition de l'actif du compartiment RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE au 30 juin 2023 ci-jointe.

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

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

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

A Paris La Défense, le 24 août 2023

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés

  
Olivier GALIENNE

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 100039 RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

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

0 - Actions & Valeurs assimilées

Actions & valeurs assimilées négo. sur un marché réglementé

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

DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE

CH0038863350	NESTLE SA-REG	7,554.	P CHF	108.1	M 30/06/23	107.6	T	832,997.45	830,415.20	0.00	-2,582.25	1.00
CH0012032048	ROCHE HOLDING AG	2,582.	P CHF	328.4121	M 30/06/23	273.5	T	782,573.43	721,472.21	0.00	-61,101.22	0.87

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE

CUMUL (EUR) 1,615,570.88 1,551,887.41 0.00 -63,683.47 1.87

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FR0000120073	AIR LIQUIDE	6,768.	P EUR	131.4297	M 30/06/23	164.2	T	889,515.96	1,111,305.60	0.00	221,789.64	1.34
NL0000235190	AIRBUS SE	7,599.	P EUR	101.4755	M 30/06/23	132.36	T	771,112.05	1,005,803.64	0.00	234,691.59	1.21
FR0010220475	ALSTOM	29,476.	P EUR	36.5086	M 30/06/23	27.32	T	1,076,127.31	805,284.32	0.00	-270,842.99	0.97
FR0000131104	BNP PARIBAS	14,658.	P EUR	60.3376	M 30/06/23	57.72	T	884,428.66	846,059.76	0.00	-38,368.90	1.02
FR0000121667	ESSILORLUXOTTICA	5,425.	P EUR	152.8029	M 30/06/23	172.6	T	828,955.62	936,355.00	0.00	107,399.38	1.13
FR0000121014	LVMH	2,085.	P EUR	662.6885	M 30/06/23	863.	T	1,381,705.59	1,799,355.00	0.00	417,649.41	2.16
FR0000120271	TOTALENERGIES SE	15,589.	P EUR	40.1526	M 30/06/23	52.55	T	625,938.16	819,201.95	0.00	193,263.79	0.99

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CUMUL (EUR) 6,457,783.35 7,323,365.27 0.00 865,581.92 8.81

DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

IE00B4BNMY34	ACCENTURE PLC - CL A	2,852.	P USD	274.3609	M 30/06/23	308.58	T	789,200.63	809,930.20	0.00	20,729.57	0.97
US0231351067	AMAZON.COM INC	6,042.	P USD	161.2746	M 30/06/23	130.36	T	820,852.12	724,862.07	0.00	-95,990.05	0.87
US5184391044	ESTEE LAUDER - A	3,365.	P USD	268.147	M 30/06/23	196.38	T	828,889.79	608,152.68	0.00	-220,737.11	0.73
US5949181045	MICROSOFT CORP	3,299.	P USD	292.2042	M 30/06/23	340.54	T	866,376.66	1,033,905.26	0.00	167,528.60	1.24
US8835561023	THERMO FISHER SC SHS	1,714.	P USD	514.8495	M 30/06/23	521.75	T	748,161.17	823,007.09	0.00	74,845.92	0.99

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

CUMUL (EUR) 4,053,480.37 3,999,857.30 0.00 -53,623.07 4.81

Warrants sur actions négociés sur marchés regl. ou ass

DEVISE VALEUR : EUR EURO

CH0511551407	UBS AG ZCP 12-29	(999) 191229 691,000.	M EUR	131.73	% 30/06/23	124.85	E	910,254.30	862,713.50	0.00	-47,540.80	1.04
--------------	------------------	-----------------------	-------	--------	------------	--------	---	------------	------------	------	------------	------

Actions & valeurs assimilées négo. sur un marché réglementé

CUMUL (EUR) 13,037,088.90 13,737,823.48 0.00 700,734.58 16.52

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

XS2387239069	BNP PAR IS ZCP 06-32	(999) 220632 1,713,000.	M EUR	100.	% 30/06/23	120.015	E	1,713,000.00	2,055,856.95	0.00	342,856.95	2.47
--------------	----------------------	-------------------------	-------	------	------------	---------	---	--------------	--------------	------	------------	------

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 100039 RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

V A L E U R	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<-----> PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	>-----> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
<b>Obligations convertibles négo. sur un marché regl.</b>												
<i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>												
XS2392635343	BNP PAR IS ZCP 07-32	(999) 060732	700,000.	M EUR	103.01	% 30/06/23	107.085	E	721,070.00	749,595.00	0.00	28,525.00 0.90
FR001400DY04	MORG STAN ZCP 06-25	(999) 060625	3,292,000.	M EUR	90.1	% 30/06/23	97.865	E	2,966,092.00	3,221,715.80	0.00	255,623.80 3.88
<i>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>												
								CUMUL (EUR)	3,687,162.00	3,971,310.80	0.00	284,148.80 4.78
<b>Obligations &amp; valeurs assimilées négociés sur un marché réglementé</b>												
								CUMUL (EUR)	5,400,162.00	6,027,167.75	0.00	627,005.75 7.25
<b>III - Titres d'OPCVM</b>												
<i>OPCVM français à vocation générale</i>												
<i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>												
FR0013476249	R CO THEMCO TGT 26 IC		2,566.	P EUR	1193.1749	M 29/06/23	1161.93	5	3,061,686.69	2,981,512.38	0.00	-80,174.31 3.59
FR0013513165	R-CO 4CH GREEN BD P		33,733.53	P EUR	99.7333	M 29/06/23	87.12	5	3,364,355.61	2,938,865.13	0.00	-425,490.48 3.53
FR0010807123	R-CO CV CRED ICEUR		739.	P EUR	1419.0468	M 29/06/23	1350.37	5	1,048,675.61	997,923.43	0.00	-50,752.18 1.20
FR0010839555	R-CO CVICT EQ VAL I		9.0765	P EUR	161825.0647	M 29/06/23	188580.03	5	1,468,805.20	1,711,646.64	0.00	242,841.44 2.06
FR0013269453	R-CO TA 2024 HYICEUR		1,946.	P EUR	997.9042	M 29/06/23	1115.15	5	1,941,921.66	2,170,081.90	0.00	228,160.24 2.61
FR0007001581	R-CO THEM GO MI C E		31,390.	P EUR	72.2366	M 29/06/23	80.42	5	2,267,505.65	2,524,383.80	0.00	256,878.15 3.04
FR0010906305	R-CO THEMATIC SIL I		7.7613	P EUR	160166.141	M 29/06/23	169788.43	5	1,243,097.47	1,317,778.94	0.00	74,681.47 1.59
FR0013417524	R-CO VALOR BOND OPPC		30,416.	P EUR	105.7439	M 29/06/23	105.3	5	3,216,306.01	3,202,804.80	0.00	-13,501.21 3.85
FR0011069137	RMM ACTIONS USA H		8,771.	P EUR	179.2309	M 29/06/23	188.28	5	1,572,034.35	1,651,403.88	0.00	79,369.53 1.99
FR0013127222	RMM TRÉSORERIE C		755.	P EUR	982.787	M 29/06/23	995.6	5	742,004.20	751,678.00	0.00	9,673.80 0.90
<i>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>												
								CUMUL (EUR)	19,926,392.45	20,248,078.90	0.00	321,686.45 24.35
<i>OPCVM européens coordonnés et assimilables</i>												
<i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>												
FR0000284150	ESSOR EMERG MK CEUR		143.	P EUR	6032.3741	M 29/06/23	5213.09	5	862,629.50	745,471.87	0.00	-117,157.63 0.90
IE00B3NFB059	HERMS-GL EM-REURA		172,119.	P EUR	4.8591	M 30/06/23	4.2982	Y	836,342.68	739,801.89	0.00	-96,540.79 0.89
FR0011499607	R-CO CV CRED 12M IC		23.6249	P EUR	102656.7566	M 29/06/23	102571.69	5	2,425,255.61	2,423,245.92	0.00	-2,009.69 2.91
FR001400BU98	R-CO TARG 2028 IG P		80,766.	P EUR	100.6583	M 29/06/23	102.9	5	8,129,764.41	8,310,821.40	0.00	181,056.99 10.00
FR0013367299	R-co Valor Bal P EUR		88,195.	P EUR	115.7665	M 29/06/23	118.7	5	10,210,025.56	10,468,746.50	0.00	258,720.94 12.59
FR0007442496	RMM COURT TERME C		132.	P EUR	3970.3855	M 29/06/23	3970.52	5	524,090.89	524,108.64	0.00	17.75 0.63
IE00B3ZWOK18	iShares S&P 500 EUR		76,215.	P EUR	89.1299	M 30/06/23	94.4797	Y	6,793,033.72	7,200,770.34	0.00	407,736.62 8.66
<i>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>												
								CUMUL (EUR)	29,781,142.37	30,412,966.56	0.00	631,824.19 36.58
<i>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</i>												
IE0031814852	FIRST ST GR CH I		16,411.	P USD	146.6868	M 30/06/23	118.3349	0	2,143,668.74	1,787,220.73	0.00	-356,448.01 2.15
IE00BF16M727	FT CYBERSECURITY		15,710.	P USD	28.8552	M 30/06/23	29.304	Y	431,337.77	423,675.54	0.00	-7,662.23 0.51
LU0129472758	JPMF CHINA JPMCC		45,129.	P USD	70.9668	M 30/06/23	46.75	0	2,794,351.20	1,941,635.15	0.00	-852,716.05 2.34
LU0360484686	MSIF US ADVANT. Z C		3,438.	P USD	163.7765	M 30/06/23	110.51	0	482,463.31	349,653.40	0.00	-132,809.91 0.42
<i>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</i>												
								CUMUL (EUR)	5,851,821.02	4,502,184.82	0.00	-1,349,636.20 5.42

## Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 100039 RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

V A L E U R	STATUTS DOSSIER VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P. R. U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<----- PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	>----- PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET	
<b>Autres OPC cotés</b>													
<b>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</b>													
LU1681040652	AMU US TRE 710 ETF	12,183.	P USD	249.0896	M 01/06/23	256.17	5	3,054,649.77	2,872,187.66	0.00	-182,462.11	3.45	
IE00BYXSP02	ISHS TRE BD USD-ACC	419,885.	P USD	5.1786	M 30/06/23	5.2272	Y	2,039,040.83	2,019,899.57	0.00	-19,141.26	2.43	
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</b>													
								CUMUL (EUR)	5,093,690.60	4,892,087.23	0.00	-201,603.37	5.88
<b>Autres OPC non cotés</b>													
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
LU1734559922	RPBDLEEACI EUR	14,164.	P EUR	103.1279	M 28/06/23	113.8662	5	1,460,704.03	1,612,800.86	0.00	152,096.83	1.94	
<b>III - Titres d'OPCVM</b>													
								CUMUL (EUR)	62,113,750.47	61,668,118.37	0.00	-445,632.10	74.18
<b>VIII - TRESORERIE</b>													
<b>Dettes et créances</b>													
<b>Règlements différés</b>													
<b>DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE</b>													
VRDCHF	Vte rgl t di fféré	3,653.05	CHF	1.02218146	30/06/23	1.02165917		3,734.08	3,732.17	0.00	-1.91	0.00	
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
RACHEUR	Rachats a payer	-396,804.9	EUR	1.	30/06/23	1.		-396,804.90	-396,804.90	0.00	0.00	-0.48	
SOUSEUR	Souscriptions/payer	280,460.46	EUR	1.	30/06/23	1.		280,460.46	280,460.46	0.00	0.00	0.34	
VRDEUR	Vte rgl t di fféré	1,772,189.49	EUR	1.	30/06/23	1.		1,772,189.49	1,772,189.49	0.00	0.00	2.13	
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
								CUMUL (EUR)	1,655,845.05	1,655,845.05	0.00	0.00	1.99
<b>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</b>													
VRDUSD	Vte rgl t di fféré	25,120.31	USD	0.91424389	30/06/23	0.92030186		22,966.09	23,118.27	0.00	152.18	0.03	
<b>Règlements différés</b>													
								CUMUL (EUR)	1,682,545.22	1,682,695.49	0.00	150.27	2.02
<b>Coupons et dividendes en espèces</b>													
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
FR0000120271	TOTALENERGIES SE	15,628.	P EUR	0.74	30/06/23			11,564.72	11,564.72	0.00	0.00	0.01	
<b>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</b>													
US8835561023	THERMO FISHER SC SHS	1,726.	P USD	0.2975029	30/06/23			475.06	472.57	0.00	-2.49	0.00	
<b>Coupons et dividendes en espèces</b>													
								CUMUL (EUR)	12,039.78	12,037.29	0.00	-2.49	0.01

## Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 100039 RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE

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
<b>Frais de gestion</b>																			
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>																			
FGPREUR						Frais gest. rétro.		7,673.02	EUR	1.	30/06/23	1.			7,673.02	7,673.02	0.00	0.00	0.01
FGPVFC2EUR						Frais de Gest. Fixe		-37,905.98	EUR	1.	30/06/23	1.			-37,905.98	-37,905.98	0.00	0.00	-0.05
FGPVFD1EUR						Frais de Gest. Fixe		-33.3	EUR	1.	30/06/23	1.			-33.30	-33.30	0.00	0.00	0.00
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>																			
													CUMUL (EUR)		-30,266.26	-30,266.26	0.00	0.00	-0.04
<b>Dettes et créances</b>																			
													CUMUL (EUR)		1,664,318.74	1,664,466.52	0.00	147.78	2.00
<b>Disponibilités</b>																			
<b>Avoirs en france</b>																			
<b>DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE</b>																			
BQRCCHF						ROTHSCHILD MM		31,582.14	CHF	1.02049481	30/06/23	1.02165917			32,229.41	32,266.18	0.00	36.77	0.04
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>																			
BQRCEUR						ROTHSCHILD MM		335.54	EUR	1.	30/06/23	1.			335.54	-50.43	-385.97	0.00	0.00
<b>DEVISE VALEUR : JPY YEN</b>																			
BQRCJPY						ROTHSCHILD MM		1.	JPY	0.01	30/06/23	0.00636294			0.01	0.01	0.00	0.00	0.00
<b>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</b>																			
BQRCUSD						ROTHSCHILD MM		9,251.92	USD	0.9154997	30/06/23	0.92030186			8,470.13	8,510.83	-3.73	44.43	0.01
<b>Avoirs en france</b>																			
													CUMUL (EUR)		41,035.09	40,726.59	-389.70	81.20	0.05
<b>VIII - TRESORERIE</b>																			
													CUMUL (EUR)		1,705,353.83	1,705,193.11	-389.70	228.98	2.05
<b>PORTEFEUILLE : RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE (100039)</b>																			
													(EUR)		82,256,355.20	83,138,302.71	-389.70	882,337.21	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 : 100039 RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

Portefeuille titres : 81,433,109.6      Coupons et dividendes a recevoir : 12,037.29

Frais de gestion du jour

Frais de Gest. Fixe : 1.13 EUR  
Frais de Gest. Fixe : 1,274.7 EUR

Frais de gestion charge Entreprise

FRAIS MAXIMUM : 1,274.7 EUR  
Frais maximum notice : 1.13 EUR

Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
C2 FR0007035571 RMM STRAT DIVER C	EUR	83,064,937.60	485,882.4102	170.96	99.91175338239			177.80	169.25
D1 FR0013329349 RMM STRAT DIVERS D	EUR	73,365.11	680.0746	107.88	0.088244661761			112.20	106.80

Actif net total en EUR : 83,138,302.71

Precedente VL en date du 29/06/23 :

C2	RMM STRAT DIVER C	Prec. VL :	170.34	(EUR)	Variation :	+0.364%
D1	RMM STRAT DIVERS D	Prec. VL :	107.49	(EUR)	Variation :	+0.363%

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 100039 RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE

VL VALIDEE

Devise du portefeuille : EUR

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

## COURS DES DEVICES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente	variation		
Cours EUR en CHF :	0.9788	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 JPY :	157.16	cotation :	30/06/23	0.	157.74	cotation :	29/06/23	-0.36769
Cours EUR en USD :	1.0866	cotation :	30/06/23	0.	1.0938	cotation :	29/06/23	-0.65826

## COURS INVERSES DES DEVICES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente		
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 JPY en EUR :	0.0063629422	cotation :	30/06/23	0.	0.006339546	cotation :	29/06/23
Cours USD en EUR :	0.920301859	cotation :	30/06/23	0.	0.9142439202	cotation :	29/06/23



# **RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE**

**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	19 764 991,23
b) Avoirs bancaires	40 777,02
c) Autres actifs détenus par l'OPC	63 767 329,07
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	83 573 097,32
e) Passif	-434 794,61
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	83 138 302,71

\* 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
RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE C en EUR	C	83 064 937,60	485 882,4102	170,96
RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE D en EUR	D	73 365,11	680,0746	107,88

## 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.	13,16	13,09
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.	10,62	10,56
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.	74,18	73,79

\* 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	14 213 246,52	17,10	17,01
Dollar Us	USD	3 999 857,30	4,81	4,79
Franc Suisse	CHF	1 551 887,41	1,87	1,86
TOTAL		19 764 991,23	23,77	23,65

\* 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	7,60	7,56
PAYS-BAS	4,58	4,56
ROYAUME-UNI	3,88	3,85
ETATS-UNIS	3,84	3,82
SUISSE	2,90	2,89
IRLANDE	0,97	0,97
TOTAL	23,77	23,65

\* 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	66,35	66,01
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	5,88	5,85
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés	1,94	1,93
Autres organismes non européens	0,00	0,00
<b>Autres actifs</b>		
Autres	0,00	0,00
<b>TOTAL</b>	<b>74,18</b>	<b>73,79</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.	278 018,62	831 337,09
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.	1 026 300,90	1 607 183,11
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.	17 918 853,02	24 153 249,61

## DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Action	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
<b>Dividendes versés</b>			
<b>Dividendes à verser</b>			
RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE D			

## INFORMATION SUR LES FRAIS DE GESTION VARIABLES

	30/06/2023
<b>Action RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE C</b>	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	-0,08
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
<b>Action RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE D</b>	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,08
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00



**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>ETATS-UNIS</b>				
AMAZON.COM INC	USD	6 042	724 862,07	0,87
ESTEE LAUDER COMPANIES INC -A-	USD	3 365	608 152,68	0,74
MICROSOFT CORP	USD	3 299	1 033 905,26	1,24
THERMO FISHER SCIEN SHS	USD	1 714	823 007,09	0,99
<b>TOTAL ETATS-UNIS</b>			<b>3 189 927,10</b>	<b>3,84</b>
<b>FRANCE</b>				
AIR LIQUIDE	EUR	6 768	1 111 305,60	1,34
ALSTOM	EUR	29 476	805 284,32	0,97
BNP PARIBAS	EUR	14 658	846 059,76	1,02
ESSILORLUXOTTICA	EUR	5 425	936 355,00	1,13
LVMH (LOUIS VUITTON - MOET HENNESSY)	EUR	2 085	1 799 355,00	2,16
TOTALENERGIES SE	EUR	15 589	819 201,95	0,98
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>6 317 561,63</b>	<b>7,60</b>
<b>IRLANDE</b>				
ACCENTURE PLC - CL A	USD	2 852	809 930,20	0,97
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>809 930,20</b>	<b>0,97</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
AIRBUS SE	EUR	7 599	1 005 803,64	1,21
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>1 005 803,64</b>	<b>1,21</b>
<b>SUISSE</b>				
NESTLE SA-REG	CHF	7 554	830 415,20	1,00
ROCHE HOLDING AG-GENUSSSCHEIN	CHF	2 582	721 472,21	0,87
UBS AG ZCP 19-12-29	EUR	691 000	862 713,50	1,03
<b>TOTAL SUISSE</b>			<b>2 414 600,91</b>	<b>2,90</b>
<b>TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>13 737 823,48</b>	<b>16,52</b>
<b>TOTAL Actions et valeurs assimilées</b>			<b>13 737 823,48</b>	<b>16,52</b>
<b>Obligations et valeurs assimilées</b>				
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>PAYS-BAS</b>				
BNP PAR ISSUANCE BV ZCP 06-07-32 CV RCB	EUR	700 000	749 595,00	0,90
BNP PAR ISSUANCE BV ZCP 22-06-32	EUR	1 713 000	2 055 856,95	2,47
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>2 805 451,95</b>	<b>3,37</b>
<b>ROYAUME-UNI</b>				
MORGAN STANLEY AND CO INTL ZCP 06-06-25 CV RCB	EUR	3 292 000	3 221 715,80	3,88
<b>TOTAL ROYAUME-UNI</b>			<b>3 221 715,80</b>	<b>3,88</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>6 027 167,75</b>	<b>7,25</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées</b>			<b>6 027 167,75</b>	<b>7,25</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>				
ESSOR EMERGING MARKETS C EUR	EUR	143	745 471,87	0,90
R-CO 4CHANGE GREEN BONDS P EUR	EUR	33 733,53	2 938 865,13	3,54

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
R-CO CONVICTION CREDIT 12M EURO IC EUR	EUR	23,6249	2 423 245,92	2,91
R-CO CONVICTION CREDIT EURO IC EUR	EUR	739	997 923,43	1,20
R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO I EUR	EUR	9,0765	1 711 646,64	2,06
R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD IC EUR	EUR	1 946	2 170 081,90	2,61
R-CO TARGET 2028 IG P EUR	EUR	80 766	8 310 821,40	9,99
R-CO THEMATIC GOLD MIINING C EUR	EUR	31 390	2 524 383,80	3,04
R-CO THEMATIC SILVER PLUS I	EUR	7,7613	1 317 778,94	1,58
R CO THEMATIC TARGET 2026 HY IC EUR	EUR	2 566	2 981 512,38	3,59
R-co Valor Balanced P EUR	EUR	88 195	10 468 746,50	12,59
R-CO VALOR BOND OPPORTUNITIES C EUR	EUR	30 416	3 202 804,80	3,85
RMM ACTIONS USA H	EUR	8 771	1 651 403,88	1,99
RMM COURT TERME C	EUR	132	524 108,64	0,63
RMM TRÉSORERIE C EUR	EUR	755	751 678,00	0,90
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>42 720 473,23</b>	<b>51,38</b>
<b>IRLANDE</b>				
FIRST STATE GR CHINA GRW FD CL I	USD	16 411	1 787 220,73	2,15
First Trust Nasdaq Cybersecurity UCITS ETF Class A USD Accum	USD	15 710	423 675,54	0,51
HERMES GL EMER MKT-R EUR ACC	EUR	172 119	739 801,89	0,89
iShares S&P 500 EUR Hedged UCITS ETF (Acc)	EUR	76 215	7 200 770,34	8,66
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>10 151 468,50</b>	<b>12,21</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
JPMF CHINA FD SHS JPM C ACC USD C	USD	45 129	1 941 635,15	2,34
MISF US ADVANTAGE FD CL.Z CAP.	USD	3 438	349 653,40	0,42
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>2 291 288,55</b>	<b>2,76</b>
<b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>			<b>55 163 230,28</b>	<b>66,35</b>
<b>Fonds professionnels à vocation générale et équival. d'autres Etats membres UE et organismes de titrisation cotés</b>				
<b>IRLANDE</b>				
ISHARES \$ TREASURY BOND 1-3YR UCITS ETF USD ACC	USD	419 885	2 019 899,57	2,44
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>2 019 899,57</b>	<b>2,44</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
AMUNDI US TREASURY 7-10 UCITS ETF USD C	USD	12 183	2 872 187,66	3,45
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>2 872 187,66</b>	<b>3,45</b>
<b>TOTAL Fonds professionnels à vocation générale et équival. d'autres Etats membres UE et organismes de titrisation cotés</b>			<b>4 892 087,23</b>	<b>5,89</b>
<b>Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres UE et organismes de titrisation non cotés</b>				
<b>LUXEMBOURG</b>				
R PORT BDL EUROPEAN EQUITY ALPHA CI EUR	EUR	14 164	1 612 800,86	1,94
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>1 612 800,86</b>	<b>1,94</b>
<b>TOTAL Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres UE et organismes de titrisation non cotés</b>			<b>1 612 800,86</b>	<b>1,94</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>61 668 118,37</b>	<b>74,18</b>
<b>Créances</b>			<b>2 099 210,70</b>	<b>2,52</b>
<b>Dettes</b>			<b>-434 744,18</b>	<b>-0,52</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>40 726,59</b>	<b>0,05</b>
<b>Actif net</b>			<b>83 138 302,71</b>	<b>100,00</b>

<b>Parts RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE C</b>	<b>EUR</b>	<b>485 882,4102</b>	<b>170,96</b>
<b>Parts RMM STRATEGIE DIVERSIFIEE D</b>	<b>EUR</b>	<b>680,0746</b>	<b>107,88</b>