

RMM CONVERTIBLES

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. 214-24-55 du code monétaire et financier	52 822 059,39
b) Avoirs bancaires	2 545,24
c) Autres actifs détenus par l'OPC	599 548,52
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	53 424 153,15
e) Passif	-151 623,84
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	53 272 529,31

* Les montants sont signés

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

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
RMM CONVERTIBLES C EUR	C	53 272 529,31	370 712,6045	143,70

ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Éléments 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.	98,76	98,48
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 du fonds d'investissement à vocation générale.	0,40	0,39
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4 ° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	1,13	1,12

* 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	52 822 059,39	99,15	98,87
TOTAL		52 822 059,39	99,15	98,87

* 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	37,81	37,70
ALLEMAGNE	24,20	24,13
ESPAGNE	12,29	12,25
ITALIE	11,71	11,67
PAYS-BAS	6,59	6,57
BELGIQUE	2,79	2,78
LUXEMBOURG	2,48	2,48
IRLANDE	0,73	0,73
ROYAUME-UNI	0,40	0,39
SUEDE	0,16	0,16
TOTAL	99,15	98,87

* 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 **
Organismes de placement collectif		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	1,13	1,12
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
Autres actifs		
Autres	0,00	0,00
TOTAL	1,13	1,12

* 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.	5 539 746,96	11 254 222,98
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 du fonds d'investissement à vocation générale.	0,00	0,00
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4 ° du I de l'article R.214-32-18 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	4 318 889,29	4 980 927,76

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2023 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
DELIVERY HERO SE 2.125% 10-03-29	EUR	500 000	339 644,18	0,64
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2.0% 17-11-25 CV	EUR	1 200 000	1 389 154,43	2,60
DEUTSCHE POST AG 0.05% 30-06-25	EUR	2 100 000	2 042 277,47	3,84
HELLOFRESH SE 0.75% 13-05-25	EUR	900 000	833 215,30	1,57
LEG IMMOBILIEN AG 0.4% 30-06-28	EUR	700 000	525 842,42	0,98
LEG IMMOBILIEN AG 0.875% 01-09-25	EUR	1 300 000	1 165 894,79	2,19
MTU AERO ENGINES GMBH 0.05% 18-03-27	EUR	900 000	826 539,79	1,55
RAG STIFTUNG ZCP 02-10-24 CV	EUR	400 000	378 014,00	0,70
RAG STIFTUNG ZCP 17-06-26 CV	EUR	2 000 000	1 822 280,00	3,43
RHEINMETALL AG 2.25% 07-02-30	EUR	400 000	432 248,70	0,81
TAG IMMOBILIEN AG 0.625% 27-08-26	EUR	1 400 000	1 099 472,75	2,07
TUI AG 5.0% 16-04-28 CV	EUR	200 000	181 868,47	0,34
ZALANDO SE 0.625% 06-08-27 CV	EUR	2 300 000	1 857 169,34	3,49
TOTAL ALLEMAGNE			12 893 621,64	24,21
BELGIQUE				
GRUPE BRUXELLES LAMBERT 2.125% 29-11-25	EUR	400 000	404 137,42	0,76
UMICORE ZCP 23-06-25 CV	EUR	1 200 000	1 080 912,00	2,03
TOTAL BELGIQUE			1 485 049,42	2,79
ESPAGNE				
AMADEUS CM 1.5% 09-04-25 CV	EUR	1 300 000	1 694 952,47	3,18
CELLNEX TELECOM 0.5% 05-07-28 CV	EUR	2 100 000	2 210 693,73	4,15
CELLNEX TELECOM 0.75% 20-11-31 CV	EUR	300 000	239 531,65	0,44
CELLNEX TELECOM 1.5% 16-01-26 CV	EUR	600 000	780 594,12	1,47
INDR SIST 1.25% 07-10-23	EUR	600 000	597 711,28	1,13
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROU 1.125% 18-05-28	EUR	1 200 000	1 021 256,18	1,91
TOTAL ESPAGNE			6 544 739,43	12,28
FRANCE				
ACCOR 0.7% 07-12-27 CV	EUR	30 000	1 418 190,00	2,66
AIR FRANCE KLM 0.125% 25-03-26	EUR	30 000	517 515,00	0,97
ATOS SE ZCP 06-11-24 CV	EUR	1 000 000	878 060,00	1,65
BNP PAR ZCP 13-05-25 CV	EUR	1 100 000	1 281 808,00	2,41
CLARIANE 1.875% PERP CV	EUR	30 000	895 710,00	1,68
EDENRED ZCP 06-09-24 CV	EUR	9 000	582 817,50	1,09
EDENRED ZCP 14-06-28 CV	EUR	19 000	1 283 602,00	2,41
ELIS EX HOLDELIS 2.25% 22-09-29	EUR	500 000	628 719,25	1,18
FNAC DARTY 0.25% 23-03-27 CV	EUR	14 000	958 328,00	1,80
MAISON DU MONDE SAS 0.125% 06-12-23	EUR	8 000	380 644,00	0,71
NEOEN 2.875% 14-09-27 CV	EUR	500 000	473 077,50	0,89
NEXITY 0.875% 19-04-28 CV	EUR	24 453	995 102,61	1,87
ORPEA 0.375% 17-05-27 CV	EUR	14 000	584 220,00	1,10
SAFRAN 0.875% 15-05-27 CV	EUR	12 000	1 796 718,00	3,37
SAFRAN ZCP 01-04-28 CV	EUR	4 000	699 016,00	1,32
SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.0% 15-06-26	EUR	8 700	1 661 434,65	3,12
SELENA SARL ZCP 25-06-25 CV	EUR	7	651 822,50	1,22

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SOITEC ZCP 01-10-25 CV	EUR	4 000	754 926,00	1,41
SPIE 2.0% 17-01-28 CV	EUR	700 000	751 924,44	1,41
UBISOFT ENTERTAINMENT 2.375% 15-11-28	EUR	600 000	614 070,49	1,16
VEOLIA ENVIRONNEMENT ZCP 01-01-25	EUR	54 000	1 740 933,00	3,27
WENDEL 2.625% 27-03-26 CV	EUR	600 000	593 310,25	1,11
TOTAL FRANCE			20 141 949,19	37,81
IRLANDE				
GLANBIA CO OPERATIVE SOCIETY 1.875% 27-01-27	EUR	400 000	391 517,48	0,73
TOTAL IRLANDE			391 517,48	0,73
ITALIE				
DIASORIN ZCP 05-05-28 CV	EUR	1 400 000	1 089 956,00	2,04
NEXI 1.75% 24-04-27 CV	EUR	1 300 000	1 125 000,25	2,11
NEXI ZCP 24-02-28 CV	EUR	1 500 000	1 135 687,50	2,13
PIRELLI C ZCP 22-12-25 CV	EUR	1 100 000	1 057 056,00	1,99
PRYSMIAN 0.0000010% 02-02-26	EUR	1 700 000	1 828 996,00	3,43
TOTAL ITALIE			6 236 695,75	11,70
LUXEMBOURG				
LAGFIN SCA 3.5% 08-06-28 CV	EUR	600 000	611 130,80	1,15
OLIVER CAPITAL SARL ZCP 29-12-23	EUR	700 000	712 134,50	1,34
TOTAL LUXEMBOURG			1 323 265,30	2,49
PAYS-BAS				
AMERICA MOVIL BV ZCP 02-03-24	EUR	1 200 000	1 265 496,00	2,38
JUST EAT TAKEAWAYCOM NV 0.625% 09-02-28	EUR	1 600 000	1 055 997,52	1,98
JUST EAT TAKEAWAYCOM NV 2.25% 25-01-24	EUR	1 200 000	1 189 199,70	2,23
TOTAL PAYS-BAS			3 510 693,22	6,59
ROYAUME-UNI				
BARCLAYS BK ZCP 24-01-25 CV	EUR	200 000	210 809,00	0,40
TOTAL ROYAUME-UNI			210 809,00	0,40
SUEDE				
FASTIGHETS AB BALDER 3.5% 23-02-28	EUR	100 000	83 718,96	0,15
TOTAL SUEDE			83 718,96	0,15
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			52 822 059,39	99,15
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			52 822 059,39	99,15
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
RMM COURT TERME C	EUR	151	599 548,52	1,13
TOTAL FRANCE			599 548,52	1,13
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			599 548,52	1,13
TOTAL Organismes de placement collectif			599 548,52	1,13
Dettes			-151 623,84	-0,28
Comptes financiers			2 545,24	0,00
Actif net			53 272 529,31	100,00

Parts RMM CONVERTIBLES C EUR	EUR	370 712,6045	143,70
-------------------------------------	------------	---------------------	---------------