

R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE

DOCUMENT D'INFORMATION PÉRIODIQUE AU 30/06/2021

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	138 852 379,81
b) Avoirs bancaires	990 154,70
c) Autres actifs détenus par l'OPC	4 865 100,73
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	144 707 635,24
e) Passif	-4 056 935,25
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	140 650 699,99

* 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
R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE C EUR en EUR	C	95 993 034,87	330 842,0091	290,15
R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE CL EUR en EUR	C	6 971 906,58	23 650,9761	294,78
R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE IC EUR en EUR	C	36 727 867,55	298,6781	122 968,06
R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE P EUR en EUR	C	957 890,99	919,4673	1 041,79

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.	89,22	86,72
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.	9,50	9,24
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.	0,21	0,20

* 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	103 130 528,76	73,32	71,27
Dollar Us	USD	21 883 778,67	15,56	15,12
Franc Suisse	CHF	8 082 947,31	5,75	5,59
Livre Sterling	GBP	5 755 125,07	4,09	3,98
TOTAL		138 852 379,81	98,72	95,95

* 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	42,92	41,72
ALLEMAGNE	17,10	16,63
PAYS-BAS	9,20	8,94
ITALIE	8,60	8,36
ESPAGNE	7,62	7,41
SUISSE	4,84	4,71
ROYAUME-UNI	3,61	3,51
BELGIQUE	2,93	2,85
ETATS-UNIS	1,05	1,02
LUXEMBOURG	0,84	0,82
TOTAL	98,72	95,95

* 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 **
Organismes de placement collectif		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	0,21	0,20
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	0,21	0,20

* 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

Éléments 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.	33 503 322,50	57 846 746,40
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.	1 928 681,88	3 066 485,13
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.	17 064 752,21	17 059 154,12

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2021 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Actions et valeurs assimilées				
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
PORTUGAL				
BCO ESPIR SANTO E	EUR	1 000 000	0,00	0,00
TOTAL PORTUGAL			0,00	0,00
TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			0,00	0,00
TOTAL Actions et valeurs assimilées			0,00	0,00
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
ADIDAS AG 0.05% 12-09-23 CV	EUR	1 200 000	1 506 589,64	1,07
DELIVERY HERO SE 1.0% 23-01-27	EUR	1 600 000	2 139 503,82	1,53
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2.0% 17-11-25 CV	EUR	400 000	430 038,00	0,31
DEUTSCHE POST AG 0.05% 30-06-25	EUR	1 700 000	2 077 120,08	1,47
DEUTSCHE WOHNEN AG 0.325% 26-07-24	EUR	2 500 000	3 312 040,75	2,36
HELLOFRESH SE 0.75% 13-05-25	EUR	1 000 000	1 751 684,02	1,25
LEG IMMOBILIEN AG 0.875% 01-09-25	EUR	1 400 000	1 727 942,43	1,22
MTU AERO ENGINES GMBH 0.05% 18-03-27	EUR	1 000 000	983 090,21	0,70
RAG STIFTUNG ZCP 02-10-24 CV	EUR	2 400 000	2 450 304,00	1,75
RAG STIFTUNG ZCP 17-06-26 CV	EUR	1 400 000	1 603 609,00	1,14
SYMRISE AG 0.2375% 20-06-24	EUR	1 100 000	1 434 012,89	1,02
TAG IMMOBILIEN AG 0.625% 27-08-26	EUR	600 000	624 946,89	0,44
ZALANDO SE 0.625% 06-08-27 CV	EUR	3 000 000	4 017 122,05	2,85
TOTAL ALLEMAGNE			24 058 003,78	17,11
BELGIQUE				
COFINIMMO SA 0.1875% 15-09-21	EUR	16 500	2 443 262,25	1,74
UMICORE ZCP 23-06-25 CV	EUR	1 500 000	1 676 145,00	1,19
TOTAL BELGIQUE			4 119 407,25	2,93
ESPAGNE				
AMADEUS CM 1.5% 09-04-25 CV	EUR	2 400 000	3 257 610,30	2,32
CELLNEX TELECOM 0.5% 05-07-28 CV	EUR	2 100 000	2 882 909,20	2,05
CELLNEX TELECOM 1.5% 16-01-26 CV	EUR	500 000	926 984,01	0,66
INDR SIST 1.25% 07-10-23	EUR	2 100 000	2 119 041,03	1,50
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROU 1.125% 18-05-28	EUR	1 600 000	1 537 009,09	1,09
TOTAL ESPAGNE			10 723 553,63	7,62
ETATS-UNIS				
CORNWALL JERSEY 0.75% 16-04-26	GBP	1 300 000	1 473 458,83	1,04
TOTAL ETATS-UNIS			1 473 458,83	1,04
FRANCE				
ACCOR 0.7% 07-12-27 CV	EUR	50 000	2 620 625,00	1,87
ARCHER OBLIGATIONS ZCP 31-03-23	EUR	800 000	1 431 452,00	1,02
ATOS SE ZCP 06-11-24 CV	EUR	3 800 000	4 786 366,00	3,40
CARREFOUR ZCP 27-03-24 CV	USD	3 600 000	3 156 974,45	2,25
CIE GEN DES ETS MICHELIN ZCP 10-01-22	USD	1 600 000	1 449 835,57	1,03

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CIE GEN DES ETS MICHELIN ZCP 10-11-23	USD	1 400 000	1 210 033,73	0,86
EDENRED ZCP 06-09-24 CV	EUR	18 000	1 132 164,00	0,80
EDENRED ZCP 14-06-28 CV	EUR	23 148	1 501 275,11	1,06
EDF ZCP 14-09-24 CV	EUR	360 000	5 484 060,00	3,90
ELIS EX HOLDELIS ZCP 06-10-23	EUR	40 000	1 250 400,00	0,89
FNAC DARTY 0.25% 23-03-27 CV	EUR	22 000	1 805 628,00	1,29
FRAN ZCP 01-04-28 CV	EUR	3 750	685 976,25	0,49
KERING ZCP 30-09-22 CV EMTN	EUR	700 000	807 611,00	0,58
KORIAN 2.5% PERP CV	EUR	80 000	3 411 640,00	2,43
MAISON DU MONDE SAS 0.125% 06-12-23	EUR	42 148	1 961 336,11	1,39
NEXITY 0.25% 02-03-25 CV	EUR	23 060	1 553 632,91	1,11
NEXITY 0.875% 19-04-28 CV	EUR	32 603	1 919 501,63	1,36
ORPAR ZCP 20-06-24 CV	EUR	1 000 000	1 239 370,00	0,88
ORPEA 0.375% 17-05-27 CV	EUR	21 022	3 130 795,95	2,22
SAFRAN 0.875% 15-05-27 CV	EUR	26 000	3 672 942,00	2,61
SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.0000010% 15-06-26	EUR	11 000	2 157 721,50	1,53
SELENA SARL ZCP 25-06-25 CV	EUR	700 000	861 542,50	0,61
SOITEC ZCP 01-10-25 CV	EUR	1 500	336 460,50	0,24
STS GROUP 8% 15/02/16 CONV. DEFAULT	EUR	340	0,00	0,00
TOTALENERGIES SE 0.5% 02-12-22 CV	USD	6 600 000	5 662 713,55	4,03
UBISOFT ZCP 24-09-24 CV	EUR	19 526	2 225 114,62	1,58
VEOLIA ENVIRONNEMENT ZCP 01-01-25	EUR	105 000	3 386 197,50	2,41
VINCI 0.375% 16-02-22	USD	1 600 000	1 527 841,02	1,09
TOTAL FRANCE			60 369 210,90	42,93
ITALIE				
DIASORIN ZCP 05-05-28 CV	EUR	2 100 000	2 161 960,50	1,54
FALCK RENEWABLES 0.0% 23-09-25	EUR	900 000	924 043,50	0,65
NEXI 1.75% 24-04-27 CV	EUR	2 100 000	2 599 220,78	1,85
NEXI ZCP 24-02-28 CV	EUR	600 000	612 387,00	0,44
PIRELLI C ZCP 22-12-25 CV	EUR	1 700 000	1 755 131,00	1,24
PRYSMIAN 0.0000010% 02-02-26	EUR	1 900 000	1 920 387,00	1,37
SNAM ZCP 20-03-22	EUR	2 000 000	2 120 800,00	1,51
TOTAL ITALIE			12 093 929,78	8,60
LUXEMBOURG				
ESPIRITO SANTO 3.125% 12/18 CV IN DEFAULT	EUR	4 700 000	0,00	0,00
OLVER CAPITAL SARL ZCP 29-10-23	EUR	1 100 000	1 180 652,00	0,84
TOTAL LUXEMBOURG			1 180 652,00	0,84
PAYS-BAS				
DUFREY ONE BV 0.75% 30-03-26 CV	CHF	1 400 000	1 270 251,17	0,90
IBERDROLA INTERNATIONAL BV ZCP 11-11-22 CV	EUR	1 200 000	1 477 530,00	1,05
JUST EAT TAKEAWAYCOM NV 0.625% 09-02-28	EUR	1 400 000	1 317 664,49	0,94
QIAGEN NV 1.0% 13-11-24 CV	USD	400 000	402 246,77	0,28
QIAGEN NV ZCP 17-12-27 CV	USD	2 400 000	1 963 227,93	1,39
STMICROELECTRONICS NV 0.0000010% 04-08-25	USD	5 000 000	5 087 654,95	3,62
STMICROELECTRONICS NV 0.0000010% 04-08-27	USD	1 400 000	1 423 250,70	1,02
TOTAL PAYS-BAS			12 941 826,01	9,20

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ROYAUME-UNI				
OCADO GROUP 0.75% 18-01-27 CV	GBP	3 200 000	3 824 848,65	2,72
ROTHSCHILD'S TEC10 PERPETUAL	EUR	900 000	797 975,25	0,57
WH SMITH 1.625% 07-05-26 CV	GBP	400 000	456 817,59	0,32
TOTAL ROYAUME-UNI			5 079 641,49	3,61
SUISSE				
IDORSIA 0.75% 17-07-24 CV	CHF	1 000 000	950 928,21	0,68
SIKA AG 0.15% 05-06-25 CV	CHF	4 000 000	5 861 767,93	4,16
TOTAL SUISSE			6 812 696,14	4,84
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			138 852 379,81	98,72
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			138 852 379,81	98,72
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	74	291 773,12	0,21
TOTAL FRANCE			291 773,12	0,21
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			291 773,12	0,21
TOTAL Organismes de placement collectif			291 773,12	0,21
Instrument financier à terme				
Engagements à terme conditionnels				
Engagements à terme conditionnels sur marché réglementé				
GENERALI ASSIC 12/2021 CALL 16	EUR	600	76 590,00	0,05
TELECOM ITALIA ORD 12/2021 CALL 0.6	EUR	2 000	4 800,00	0,01
TOTAL Engagements à terme conditionnels sur marché réglementé			81 390,00	0,06
TOTAL Engagements à terme conditionnels			81 390,00	0,06
TOTAL Instrument financier à terme			81 390,00	0,06
Créances			4 491 937,61	3,19
Dettes			-4 056 935,25	-2,88
Comptes financiers			990 154,70	0,70
Actif net			140 650 699,99	100,00

Parts R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE C EUR	EUR	330 842,0091	290,15
Parts R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE CL EUR	EUR	23 650,9761	294,78
Parts R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE IC EUR	EUR	298,6781	122 968,06
Parts R-CO 4CHANGE CONVERTIBLES EUROPE P EUR	EUR	919,4673	1 041,79