

R-CO 4CHANGE CLIMATE CREDIT EURO

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	32 667 435,02
b) Avoirs bancaires	4 470,06
c) Autres actifs détenus par l'OPC	3 326 877,02
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	35 998 782,10
e) Passif	-255 271,80
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	35 743 510,30

* 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 CLIMATE CREDIT EURO C en EUR	C	33 647 495,96	826 164,3708	40,73
R-CO 4CHANGE CLIMATE CREDIT EURO D en EUR	D	579 111,54	33 007,1995	17,55
R-CO 4CHANGE CLIMATE CREDIT EURO I en EUR	C	1 516 902,80	10,0000	151 690,28

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.	82,91	82,32
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.	8,49	8,43
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.	8,54	8,48

* 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	32 431 111,67	90,73	90,09
Livre Sterling	GBP	236 323,35	0,66	0,66
TOTAL		32 667 435,02	91,39	90,75

* 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	36,12	35,86
PAYS-BAS	11,88	11,80
ESPAGNE	7,03	6,98
ALLEMAGNE	6,53	6,48
SUEDE	4,32	4,29
ITALIE	3,77	3,74
ROYAUME-UNI	3,16	3,13
LUXEMBOURG	2,96	2,94
NORVEGE	2,88	2,86
ETATS-UNIS	1,77	1,76
AUTRICHE	1,76	1,75
NOUVELLE-ZELANDE	1,44	1,43
IRLANDE	1,18	1,17
PORTUGAL	1,14	1,14
BELGIQUE	1,12	1,11
FINLANDE	0,84	0,83
AUSTRALIE	0,84	0,83
SLOVAQUIE	0,81	0,81
JERSEY	0,70	0,70
JAPON	0,58	0,57
POLOGNE	0,56	0,56
TOTAL	91,39	90,75

* 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	8,54	8,48
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
Autres actifs		
Autres	0,00	0,00
TOTAL	8,54	8,48

* 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.	17 133 175,14	4 027 493,00
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.	1 896 542,30	411 743,65
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.	12 735 889,40	9 774 098,42

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt (1) EUR	Montant brut unitaire (2) EUR
Dividendes versés				
26/03/2021	R-CO 4CHANGE CLIMATE CREDIT EURO D	0,02	0,00	0,02
Dividendes à verser				
	R-CO 4CHANGE CLIMATE CREDIT EURO D			

(1) Le crédit d'impôt unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

(2) Le montant brut unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2021 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				
BERTELSMANN 1.25% 29-09-25	EUR	200 000	213 471,41	0,59
CMZB FRANCFORT 0.75% 24-03-26	EUR	200 000	204 214,96	0,57
DEUTSCHE BOERSE AG 2.375% 05/10/2022	EUR	100 000	105 297,35	0,30
DEUTSCHE TELEKOM AG 0.875% 25-03-26	EUR	300 000	313 490,49	0,87
FRESENIUS MEDICAL CARE AG 1.0% 29-05-26	EUR	400 000	416 592,60	1,17
MEOGR 1 1/2 03/19/25	EUR	400 000	419 734,03	1,17
SCHAEFFLER AG 3.375% 12-10-28	EUR	400 000	451 461,40	1,27
SIXT SE 1.75% 09-12-24 EMTN	EUR	200 000	208 360,75	0,58
TOTAL ALLEMAGNE			2 332 622,99	6,52
AUSTRALIE				
AUSTRALIA NEW ZEA BANKING GRP LTD GTO 0.669% 05-05-31	EUR	300 000	299 154,92	0,83
TOTAL AUSTRALIE			299 154,92	0,83
AUTRICHE				
ERSTE GR BK 0.875% 22-05-26	EUR	200 000	208 644,58	0,58
IMMOFINANZ AG 2.5% 15-10-27	EUR	400 000	421 493,29	1,18
TOTAL AUTRICHE			630 137,87	1,76
BELGIQUE				
BELFIUS BANK 0.375% 08-06-27	EUR	400 000	399 436,63	1,12
TOTAL BELGIQUE			399 436,63	1,12
ESPAGNE				
BANCO DE BADELL 1.125% 11-03-27	EUR	300 000	309 608,36	0,87
BANCO SANTANDER SA 0.25% 19-06-24	EUR	100 000	101 098,40	0,28
BBVA 1.125% 28-02-24 EMTN	EUR	500 000	518 025,96	1,45
CAIXABANK 1.125% 27-03-26 EMTN	EUR	300 000	314 245,42	0,88
CAIXABANK 2.375% 01-02-24 EMTN	EUR	200 000	214 316,07	0,60
FERR EMIS 2.5% 15-07-24	EUR	300 000	330 367,38	0,92
GRIFOLS 1.625% 15-02-25	EUR	300 000	305 003,71	0,86
INMOBILIARIA COLONIAL 1.45% 28-10-24	EUR	300 000	316 364,20	0,88
SABSM 1 5/8 03/07/24	EUR	100 000	104 666,39	0,29
TOTAL ESPAGNE			2 513 695,89	7,03
ETATS-UNIS				
GOLD SACH GR 1.375% 15-05-24	EUR	100 000	102 838,32	0,29
MAN 1 3/4 06/22/26	EUR	300 000	322 183,34	0,90
XYLEM 2.25% 11-03-23	EUR	200 000	208 618,15	0,58
TOTAL ETATS-UNIS			633 639,81	1,77
FINLANDE				
NORDEA BK PUBL 0.875% 26-06-23	EUR	100 000	102 205,88	0,29
UPM KYMMENE OY 0.125% 19-11-28	EUR	200 000	197 076,11	0,55
TOTAL FINLANDE			299 281,99	0,84
FRANCE				
AIR LIQUIDE 0.375% 27-05-31	EUR	200 000	202 629,97	0,57
ARKEMA 0.125% 14-10-26 EMTN	EUR	300 000	302 675,65	0,84

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ATOS SE 1.75% 07-05-25	EUR	400 000	424 475,97	1,19
BNP 1 1/8 10/10/23	EUR	100 000	103 857,78	0,29
BNP PAR 1.125% 28-08-24	EUR	100 000	104 676,82	0,29
BPCE 0.625% 26-09-24 EMTN	EUR	300 000	307 409,22	0,86
BURE VERI 1.25% 07-09-23	EUR	200 000	206 916,10	0,57
CA 0.125% 09-12-27 EMTN	EUR	100 000	98 357,71	0,28
CA 3.0% 02-02-25	EUR	400 000	438 785,13	1,22
CAPGEMINI SE 0.5% 09-11-21	EUR	200 000	200 825,84	0,56
CAPGEMINI SE 1.0% 18-10-24	EUR	200 000	208 347,22	0,58
CARREFOUR 0.875% 12-06-23 EMTN	EUR	100 000	101 905,95	0,29
CNPFP 2 3/4 02/05/29	EUR	300 000	344 854,60	0,97
COVIVIO SA 1.625% 17-10-24	EUR	100 000	106 370,63	0,29
CREDIT MUTUEL ARKEA 1.375% 17-01-25	EUR	100 000	105 872,84	0,30
CREDIT MUTUEL ARKEA 1.875% 25-10-29	EUR	300 000	317 325,74	0,89
EDENRED 1.875% 06-03-26	EUR	100 000	108 981,16	0,30
EDF 4.625% 09-24	EUR	300 000	356 807,53	1,00
ELIS EX HOLDELIS 1.0% 03-04-25	EUR	200 000	199 842,15	0,56
ENGIE 1.5% PERP	EUR	200 000	202 768,90	0,57
ENGIE 2.125% 30-03-32 EMTN	EUR	100 000	116 383,76	0,33
ESSILORLUXOTTICA 0.375% 27-11-27	EUR	600 000	613 952,67	1,72
EUTELT 1.5% 13-10-28	EUR	300 000	316 934,14	0,89
FRFP 3 1/4 01/22/24	EUR	500 000	546 055,31	1,53
GECINA 1.375% 26-01-28 EMTN	EUR	400 000	434 739,75	1,22
GROUPAMA ASSURANCES MUTUELLES SA 6.0% 23-01-27	EUR	300 000	385 837,91	1,08
GROUPE DANONE 0.424% 03-11-22	EUR	100 000	101 198,96	0,28
I 2.0% 10-12-24 EMTN	EUR	100 000	107 439,31	0,30
ICADE 1.5% 13-09-27	EUR	500 000	544 700,00	1,52
IPSOS 2.875% 21-09-25	EUR	100 000	109 400,99	0,30
JCDECAUX 2.625% 24-04-28	EUR	500 000	560 398,66	1,57
KORIAN 4.125% PERP	GBP	200 000	236 323,35	0,66
LAGARDERE SCA 1.625% 21-06-24	EUR	200 000	200 921,95	0,56
MERCIALYS 1.787% 31-03-23	EUR	200 000	206 851,64	0,58
NEXANS 2.75% 05-04-24	EUR	500 000	531 050,07	1,49
ORANGE 0.0% 29-06-26 EMTN	EUR	500 000	500 682,50	1,40
PAPREC 4.0% 31-03-25	EUR	100 000	103 382,44	0,29
PERNOD RICARD 1.5% 18-05-26	EUR	300 000	322 450,29	0,90
PLASTIC OMNIUM SYSTEMES URBAINS 1.25% 26-06-24	EUR	300 000	305 485,64	0,86
SEB 1.5% 31-05-24	EUR	100 000	103 680,01	0,29
SG 0.75% 26-05-23 EMTN	EUR	100 000	102 133,53	0,29
SUEZ 1.0% 03-04-25 EMTN	EUR	100 000	104 220,08	0,29
TELEPERFORMANCE SE 1.875% 02-07-25	EUR	600 000	639 762,00	1,79
TOTAL CAPITAL INTL 0.696% 31-05-28	EUR	200 000	207 759,04	0,58
TOTALENERGIES SE 1.75% PERP	EUR	200 000	206 078,42	0,57
VALEO ELECTRONIQUE ET SYSTEMES DE L 0.625% 11-01-23	EUR	100 000	101 044,52	0,28
VEOLIA ENVIRONNEMENT 0.892% 14-01-24	EUR	200 000	205 600,02	0,58
WENDEL 2.75% 02-10-24	EUR	500 000	551 574,25	1,55

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TOTAL FRANCE			12 909 728,12	36,12
IRLANDE				
AIB GROUP 1.25% 28-05-24 EMTN	EUR	200 000	207 588,73	0,58
AIB GROUP 2.875% 30-05-31 EMTN	EUR	200 000	214 668,86	0,60
TOTAL IRLANDE			422 257,59	1,18
ITALIE				
ACEA 2.625% 15-07-24 EMTN	EUR	100 000	110 109,01	0,31
BANCO BPM 6.5% PERP	EUR	200 000	225 198,10	0,63
ERG SPA LANTERN 1.875% 11-04-25	EUR	100 000	106 670,73	0,30
INTESA SANPAOLO SPA 6.625% 13/09/2023	EUR	500 000	593 037,50	1,66
ITALGAS 1.125% 14-03-24 EMTN	EUR	100 000	103 680,54	0,29
UNICREDIT 2.731% 15-01-32	EUR	200 000	207 342,02	0,58
TOTAL ITALIE			1 346 037,90	3,77
JAPON				
TAKEDA PHARMACEUTICAL 0.75% 09-07-27	EUR	100 000	103 288,12	0,29
TAKEDA PHARMACEUTICAL 1.125% 21-11-22	EUR	100 000	102 579,33	0,28
TOTAL JAPON			205 867,45	0,57
JERSEY				
ATRIUM EUROPEAN REAL ESTATE 3.625% PERP	EUR	150 000	148 226,19	0,41
HTHROW 1 7/8 05/23/22	EUR	100 000	101 971,98	0,29
TOTAL JERSEY			250 198,17	0,70
LUXEMBOURG				
BECTON DICKINSON EURO FINANCE SARL 1.208% 04-06-26	EUR	300 000	314 477,01	0,88
CFRVX 1 1/8 05/26/32	EUR	200 000	213 461,08	0,60
CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE 1.75% 12-09-25	EUR	100 000	107 672,29	0,30
CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE 1.75% 25-03-27	EUR	100 000	107 494,16	0,30
GRAND CITY PROPERTIES 1.7% 09-04-24	EUR	300 000	316 268,20	0,88
TOTAL LUXEMBOURG			1 059 372,74	2,96
NORVEGE				
STATOIL ASA 2.875% 09/10/25	EUR	100 000	115 448,63	0,32
TELENOR AS 0.25% 14-02-28 EMTN	EUR	600 000	602 145,12	1,68
TELENOR AS 0.75% 31-05-26 EMTN	EUR	300 000	310 490,26	0,87
TOTAL NORVEGE			1 028 084,01	2,87
NOUVELLE-ZELANDE				
CHORUS 0.875% 05-12-26	EUR	500 000	516 242,64	1,45
TOTAL NOUVELLE-ZELANDE			516 242,64	1,45
PAYS-BAS				
ABN AMRO BK 4.375% PERP	EUR	200 000	219 130,27	0,61
AEGON BANK NV 0.625% 21-06-24	EUR	200 000	204 136,67	0,57
CONTI GUMMI FINANCE BV 2.125% 27-11-23	EUR	300 000	318 988,07	0,89
CTP BV 2.125% 01-10-25 EMTN	EUR	300 000	322 238,12	0,90
EDP FIN 0.375% 16-09-26 EMTN	EUR	400 000	405 659,67	1,14
ENEL FINANCE INTL NV 0.375% 17-06-27	EUR	300 000	303 860,73	0,85
IBER INT 1.875% 08-10-24 EMTN	EUR	400 000	432 772,30	1,21
ING GROEP NV 0.875% 09-06-32	EUR	300 000	300 423,41	0,84
KPN 4.25% 03/22	EUR	100 000	104 339,19	0,29

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
LEASEPLAN CORPORATION NV 0.125% 13-09-23	EUR	200 000	201 422,00	0,57
NATI LE 9.0 08-42	EUR	100 000	118 103,86	0,33
NATURGY FINANCE BV 1.375% 19-01-27	EUR	400 000	428 889,23	1,20
NE PROPERTY BV 3.375% 14-07-27	EUR	500 000	572 772,71	1,60
NIBC BANK NV 1.5% 31-01-22	EUR	100 000	101 690,16	0,29
NIBC BANK NV 6.0% PERP	EUR	200 000	213 290,38	0,60
TOTAL PAYS-BAS			4 247 716,77	11,89
POLOGNE				
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI 0.75% 25-07-21	EUR	200 000	201 466,48	0,57
TOTAL POLOGNE			201 466,48	0,57
PORTUGAL				
ENERGIAS DE PORTUGAL EDP 1.7% 20-07-80	EUR	200 000	204 640,33	0,58
GALP ENERGIA 1.0% 15-02-23	EUR	200 000	204 051,68	0,57
TOTAL PORTUGAL			408 692,01	1,15
ROYAUME-UNI				
COCA EURO PAR 0.75% 24-02-22	EUR	300 000	302 737,54	0,85
INTL GAME TECHNOLOGY 3.5% 15-07-24	EUR	300 000	320 173,83	0,89
LLOYDS BANKING GROUP 0.75% 09-11-21	EUR	100 000	100 907,38	0,28
NATWEST MKTS 1.0% 28-05-24	EUR	100 000	103 320,89	0,29
TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES 0.375% 27-07-29	EUR	200 000	195 865,55	0,55
WPP FINANCE 2016 1.375% 20-03-25	EUR	100 000	105 440,78	0,30
TOTAL ROYAUME-UNI			1 128 445,97	3,16
SLOVAQUIE				
SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 4.4% 11-07-29	EUR	200 000	290 519,01	0,81
TOTAL SLOVAQUIE			290 519,01	0,81
SUEDE				
AB SAGAX 2.25% 13-03-25 EMTN	EUR	100 000	107 070,75	0,30
FASTIGHETS AB BALDER 1.125% 29-01-27	EUR	400 000	409 602,63	1,15
MOLN HOLD AB 1.75% 28-02-24	EUR	400 000	421 284,08	1,18
SWEDBANK AB 0.25% 09-10-24	EUR	100 000	101 073,69	0,28
VATFAL 0 1/2 06/24/26	EUR	200 000	204 523,92	0,57
VATTENFALL AB 0.05% 15-10-25	EUR	100 000	100 432,62	0,28
VOLVO TREASURY AB 0.1% 24-05-22	EUR	200 000	200 848,37	0,56
TOTAL SUEDE			1 544 836,06	4,32
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			32 667 435,02	91,39
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			32 667 435,02	91,39
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	774	3 051 789,12	8,54
TOTAL FRANCE			3 051 789,12	8,54
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			3 051 789,12	8,54
TOTAL Organismes de placement collectif			3 051 789,12	8,54
Instrument financier à terme				

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
XEUR FGBM BOB 0921	EUR	10	-100,00	0,00
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			-100,00	0,00
TOTAL Engagements à terme fermes			-100,00	0,00
TOTAL Instrument financier à terme			-100,00	0,00
Appel de marge				
APPEL MARGE R.M.M.	EUR	100	100,00	0,00
TOTAL Appel de marge			100,00	0,00
Créances			274 987,90	0,77
Dettes			-255 171,80	-0,71
Comptes financiers			4 470,06	0,01
Actif net			35 743 510,30	100,00

Parts R-CO 4CHANGE CLIMATE CREDIT EURO C	EUR	826 164,3708	40,73
Parts R-CO 4CHANGE CLIMATE CREDIT EURO D	EUR	33 007,1995	17,55
Parts R-CO 4CHANGE CLIMATE CREDIT EURO I	EUR	10,0000	151 690,28