

# **R-co Conviction Club (Ex. R-co CLUB)**

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 2020

## R-co Conviction Club (Ex. R-co CLUB)

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 2020

---

En notre qualité de commissaire aux comptes de la SICAV R-CO et en application des dispositions prévues par l'article L 214-24-49 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 R-co Conviction Club (Ex. R-co CLUB) au 30 juin 2020 ci-jointe.

Ces informations ont été établies sous la responsabilité de la SICAV sur la base des éléments disponibles dans un contexte évolutif de crise liée au Covid-19. 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 31 juillet 2020

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés

Olivier GALIENNE

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/20  
 PORTEFEUILLE : 1514 R-CO CONVICTION CLUB

VL VALIDEE  
 Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore  
 Devise du portefeuille : EUR

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

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	<----->	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	----->	ACT NET
								PRIX REVIENT TOTA			PLUS OU MOINS VAL	

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

CH0012005267 NOVARTIS AG NOMI	10,750.	P CHF	63.1895	M	30/06/20	82.42	4	518,183.15	831,860.86	0.00	313,677.71	0.26
-------------------------------	---------	-------	---------	---	----------	-------	---	------------	------------	------	------------	------

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FR0000120404 ACCOR	70,200.	P EUR	27.4686	M	30/06/20	24.21	T	1,928,295.72	1,699,542.00	0.00	-228,753.72	0.52
NL0000303709 AEGON	1,707,715.	P EUR	4.3031	M	30/06/20	2.653	T	7,348,441.88	4,530,567.90	0.00	-2,817,873.98	1.40
FR0000031122 AIR FRANCE KLM	331,000.	P EUR	8.3913	M	30/06/20	4.033	T	2,777,522.67	1,334,923.00	0.00	-1,442,599.67	0.41
NL0000235190 AIRBUS SE	66,400.	P EUR	56.0301	M	30/06/20	63.52	T	3,720,398.82	4,217,728.00	0.00	497,329.18	1.30
FR0004125920 AMUNDI	23,400.	P EUR	48.005	M	30/06/20	69.7	T	1,123,317.68	1,630,980.00	0.00	507,662.32	0.50
BE0974293251 ANHE BUSC INBE SA/NV	58,000.	P EUR	44.11	M	30/06/20	43.865	T	2,558,380.00	2,544,170.00	0.00	-14,210.00	0.78
LU1598757687 ARCELORMITTAL	439,000.	P EUR	14.4586	M	30/06/20	9.37	T	6,347,335.31	4,113,430.00	0.00	-2,233,905.31	1.27
IT0000062072 ASSICURAZ. GENERALI	442,000.	P EUR	16.3015	M	30/06/20	13.47	T	7,205,259.10	5,953,740.00	0.00	-1,251,519.10	1.84
ES0109427734 ATRESMEDIA	579,000.	P EUR	7.792	M	30/06/20	2.326	T	4,511,554.34	1,346,754.00	0.00	-3,164,800.34	0.42
FR0000120628 AXA	97,000.	P EUR	18.3178	M	30/06/20	18.612	T	1,776,825.38	1,805,364.00	0.00	28,538.62	0.56
ES0113860A34 BANCO SABADELL	3,399,307.	P EUR	1.5308	M	30/06/20	0.3091	T	5,203,503.19	1,050,725.79	0.00	-4,152,777.40	0.32
DE000BAY0017 BAYER	88,000.	P EUR	86.1979	M	30/06/20	65.79	T	7,585,415.65	5,789,520.00	0.00	-1,795,895.65	1.78
PTBES0AM0007 BCO ESPIRITO SANTO	8,000,000.	P EUR	0.8642	M	04/08/14	0.	V	6,913,220.40	0.00	0.00	-6,913,220.40	0.00
FR0000131104 BNP PARIBAS	147,000.	P EUR	42.0492	M	30/06/20	35.37	T	6,181,233.41	5,199,390.00	0.00	-981,843.41	1.60
ES0140609019 CAIXABANK	2,187,000.	P EUR	3.5774	M	30/06/20	1.9005	T	7,823,802.89	4,156,393.50	0.00	-3,667,409.39	1.28
FR0000125338 CAPGEMINI SE	54,600.	P EUR	55.9276	M	30/06/20	101.95	T	3,053,646.24	5,566,470.00	0.00	2,512,823.76	1.72
FR0000120172 CARREFOUR	5,207.	P EUR	12.19	M	30/06/20	13.755	T	63,473.33	71,622.29	0.00	8,148.96	0.02
	270,000.	P EUR	17.5142	M	30/06/20	13.755	T	4,728,824.10	3,713,850.00	0.00	-1,014,974.10	1.14
DE000CBK1001 COMMERZBANK AG	440,000.	P EUR	11.2767	M	30/06/20	3.967	T	4,961,752.73	1,745,480.00	0.00	-3,216,272.73	0.54
DE0007100000 DAIMLER AG	171,000.	P EUR	57.7877	M	30/06/20	36.145	T	9,881,702.91	6,180,795.00	0.00	-3,700,907.91	1.91
FR0000120644 DANONE	53,700.	P EUR	66.7354	M	30/06/20	61.56	T	3,583,690.65	3,305,772.00	0.00	-277,918.65	1.02
DE0005552004 DEUTSCHE POST NAMEN	145,000.	P EUR	28.1062	M	30/06/20	32.55	T	4,075,405.99	4,719,750.00	0.00	644,344.01	1.45
DE0005557508 DEUTSCHE TELEKOM	169,000.	P EUR	13.5714	M	30/06/20	14.945	T	2,293,559.26	2,525,705.00	0.00	232,145.74	0.78
DE000DWS1007 DWS GROUP GMBH &	42,000.	P EUR	32.1159	M	30/06/20	32.31	T	1,348,868.00	1,357,020.00	0.00	8,152.00	0.42
FR0010242511 EDF	408,000.	P EUR	10.1753	M	30/06/20	8.21	T	4,151,528.87	3,349,680.00	0.00	-801,848.87	1.03
IT0003132476 ENI SPA	147,000.	P EUR	16.0612	M	30/06/20	8.49	T	2,360,991.63	1,248,030.00	0.00	-1,112,961.63	0.38
DE0006047004 HEIDELBERGER ZEMENT	66,300.	P EUR	57.3058	M	30/06/20	47.54	T	3,799,377.37	3,151,902.00	0.00	-647,475.37	0.97
DE0006048432 HENKEL AG & CO PREF	25,400.	P EUR	72.3876	M	30/06/20	82.88	T	1,838,645.20	2,105,152.00	0.00	266,506.80	0.65
FR0004035913 ILIAD	14,640.	P EUR	112.8204	M	30/06/20	173.65	T	1,651,689.96	2,542,236.00	0.00	890,546.04	0.78
IT0000072618 INTESA SANPAOLO SPA	2,673,000.	P EUR	2.0784	M	30/06/20	1.7036	T	5,555,487.50	4,553,722.80	0.00	-1,001,764.70	1.40
FR0000121261 MICHELIN - CAT.B	31,300.	P EUR	110.7864	M	30/06/20	92.34	T	3,467,615.75	2,890,242.00	0.00	-577,373.75	0.89
FI0009000681 NOKIA (AB) OY	980,000.	P EUR	4.8964	M	30/06/20	3.8715	T	4,798,441.71	3,794,070.00	0.00	-1,004,371.71	1.17
FR0000133308 ORANGE	276,000.	P EUR	14.345	M	30/06/20	10.645	T	3,959,209.51	2,938,020.00	0.00	-1,021,189.51	0.91
FR0000121501 PEUGEOT	310,000.	P EUR	13.1651	M	30/06/20	14.48	T	4,081,183.82	4,488,800.00	0.00	407,616.18	1.38
DE000PSM7770 PROSIBEN SAT.1 MEDI	173,000.	P EUR	21.1483	M	30/06/20	10.59	T	3,658,653.46	1,832,070.00	0.00	-1,826,583.46	0.56
ES0173516115 REPSOL	210,314.	P EUR	14.4211	M	30/06/20	7.786	T	3,032,968.47	1,637,504.80	0.00	-1,395,463.67	0.50
NL0000009538 ROYAL PHILIPS	84,000.	P EUR	23.1438	M	30/06/20	41.52	T	1,944,082.77	3,487,680.00	0.00	1,543,597.23	1.08
DE0007037129 RWE AG	98,600.	P EUR	21.1026	M	30/06/20	31.11	T	2,080,713.96	3,067,446.00	0.00	986,732.04	0.95
FR0000125007 SAINT-GOBAIN	244,000.	P EUR	36.6616	M	30/06/20	32.05	T	8,945,430.56	7,820,200.00	0.00	-1,125,230.56	2.41
FR0000120578 SANOFI	49,800.	P EUR	68.2074	M	30/06/20	90.65	T	3,396,726.43	4,514,370.00	0.00	1,117,643.57	1.39

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/20  
 PORTEFEUILLE : 1514 R-CO CONVICTION CLUB

VL VALIDEE  
 Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore  
 Devise du portefeuille : EUR

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

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	Devise du portefeuille				PRCT ACT NET	
								<-----> PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL		
DE0007236101 SIEMENS AG-REG		62,500.	P EUR	90.539	M 30/06/20	104.76	T	5,658,685.33	6,547,500.00	0.00	888,814.67	2.02	
FR0000130809 SOCIETE GENERALE SA		210,000.	P EUR	34.8389	M 30/06/20	14.8	T	7,316,167.25	3,108,000.00	0.00	-4,208,167.25	0.96	
NL0000226223 STMI NV		168,000.	P EUR	9.253	M 30/06/20	24.2	T	1,554,510.40	4,065,600.00	0.00	2,511,089.60	1.25	
IT0003497168 TELECOM ITALIA ORD		10,350,000.	P EUR	0.7618	M 30/06/20	0.3497	T	7,885,072.22	3,619,395.00	0.00	-4,265,677.22	1.12	
FR0000120271 TOTAL		199,000.	P EUR	39.0797	M 30/06/20	33.975	T	7,776,869.05	6,761,025.00	0.00	-1,015,844.05	2.08	
IT0005239360 UNICREDIT SPA		517,000.	P EUR	13.701	M 30/06/20	8.188	T	7,083,410.60	4,233,196.00	0.00	-2,850,214.60	1.30	
FR0000124141 VEOLIA ENVIRONNEM.		148,400.	P EUR	15.8316	M 30/06/20	20.02	T	2,349,415.74	2,970,968.00	0.00	621,552.26	0.92	
AT0000831706 WIENERBERGER AG		118,000.	P EUR	14.9975	M 30/06/20	19.39	T	1,769,704.86	2,288,020.00	0.00	518,315.14	0.71	
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
								CUMUL (EUR)	207,112,012.07	161,574,522.08	0.00	-45,537,489.99	49.81
<b>DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING</b>													
GB0000961622 BALFOUR BEATTY		559,000.	P GBP	2.2308	M 30/06/20	2.608	T	1,518,845.47	1,597,790.52	0.00	78,945.05	0.49	
GB0031348658 BARCLAYS PLC		2,332,000.	P GBP	2.1821	M 30/06/20	1.1442	T	6,085,745.87	2,924,360.66	0.00	-3,161,385.21	0.90	
GB0007980591 BP PLC		128,663.	P GBP	4.8449	M 30/06/20	3.072	T	731,718.40	433,186.92	0.00	-298,531.48	0.13	
GB0009252882 GLAXOSMITHKLINE PLC		139,600.	P GBP	14.3994	M 30/06/20	16.366	T	2,373,086.65	2,503,965.89	0.00	130,879.24	0.77	
GB0006776081 PEARSON PLC		223,000.	P GBP	7.4936	M 30/06/20	5.758	T	2,039,731.39	1,407,268.50	0.00	-632,462.89	0.43	
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING</b>													
								CUMUL (EUR)	12,749,127.78	8,866,572.49	0.00	-3,882,555.29	2.73
<b>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</b>													
JE00B4T3BW64 GLENCORE INTERNATION		1,596,000.	P GBP	1.9279	M 30/06/20	1.7122	T	3,579,566.84	2,994,937.91	0.00	-584,628.93	0.92	
<b>Bons de souscriptions sur actions nég marchés régl</b>													
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
ES0673516960 REPSOL SA-RTS		215,314.	P EUR	0.	M 30/06/20	0.4333	T	0.00	93,295.56	0.00	93,295.56	0.03	
<b>Actions &amp; valeurs assimilées négo. sur un marché réglementé</b>													
								CUMUL (EUR)	223,958,889.84	174,361,188.90	0.00	-49,597,700.94	53.75

I - Obligations & Valeurs assimilées

**Obligations & valeurs assimilées négociés sur un marché réglementé**

**Obligations à taux fixe négo. sur un marché régl.**

DEVISE VALEUR : EUR EURO

BE6311694010 ARGE SP 1.0 02-24	(366) 060224	1,200,000.	M EUR	100.5789	% 30/06/20	101.342	4	1,206,946.26	1,220,923.67	4,819.67	13,977.41	0.38
FR0013378445 ATOS SE 0.75 05-22	(366) 070522	1,000,000.	M EUR	101.9808	% 30/06/20	100.9895	4	1,019,808.22	1,011,045.68	1,150.68	-8,762.54	0.31
XS1849525057 BANK ZA 0.75 09-21	(366) 200921	1,200,000.	M EUR	100.3902	% 30/06/20	100.2295	4	1,204,682.59	1,209,786.79	7,032.79	5,104.20	0.37
XS1678372472 BBVA 0.75 09-22	(366) 110922	1,000,000.	M EUR	101.3406	% 30/06/20	100.457	4	1,013,405.52	1,010,615.08	6,045.08	-2,790.44	0.31
XS0548803757 BFCM 4% 22/10/2020	(366) 221020	1,300,000.	M EUR	107.9041	% 30/06/20	101.119	4	1,402,753.43	1,350,634.43	36,087.43	-52,119.00	0.42
FR0012872174 BOLLORRE 2.88 07-21	(366) 290721	1,300,000.	M EUR	103.3337	% 30/06/20	101.3755	4	1,343,337.74	1,352,499.33	34,617.83	9,161.59	0.42
XS1143974159 BRE FIN 11-21	(366) 261121	1,300,000.	M EUR	105.1442	% 30/06/20	101.0165	4	1,366,874.11	1,328,771.88	15,557.38	-38,102.23	0.41
FR0013201084 BURE VE 1.25 09-23	(366) 070923	1,300,000.	M EUR	101.421	% 30/06/20	99.4335	4	1,318,473.62	1,305,910.77	13,275.27	-12,562.85	0.40
XS1086835979 CARREFOUR FIX 150722	(366) 150722	1,200,000.	M EUR	106.2402	% 30/06/20	102.601	4	1,274,882.91	1,251,466.10	20,254.10	-23,416.81	0.39
FR0013213832 CNP ASS 1.875 10-22	(366) 201022	1,200,000.	M EUR	101.3631	% 30/06/20	102.211	4	1,216,356.99	1,242,269.70	15,737.70	25,912.71	0.38
XS1186131717 F 1.134 02/10/22	(EXA) 100222	1,200,000.	M EUR	100.1062	% 30/06/20	96.621	4	1,201,273.90	1,164,768.79	5,316.79	-36,505.11	0.36
XS2001270995 FCA BAN 0.625 11-22	(366) 241122	1,200,000.	M EUR	99.8212	% 30/06/20	97.9845	4	1,197,853.85	1,180,342.69	4,528.69	-17,511.16	0.36
XS0825855751 FORTUM 2.25% 06/09/22	(366) 060922	1,000,000.	M EUR	107.536	% 30/06/20	104.154	4	1,075,360.17	1,059,982.62	18,442.62	-15,377.55	0.33

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/20

PORTEFEUILLE : 1514 R-CO CONVICTION CLUB

VL VALIDEE

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

Devise du portefeuille : EUR

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

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	DOSSIER	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	
FR0012968337	FREN REP 0.25	11-20	(366) 251120	62,000,000.	M EUR	100.5119	% 30/06/20	100.3215	4	62,317,349.72	62,292,499.40	93,169.40	-24,850.32	19.20
FR0013066669	HAVAS 1.88	12-20	(366) 081220	1,300,000.	M EUR	101.2756	% 30/06/20	100.183	E	1,316,582.39	1,316,164.86	13,785.86	-417.53	0.41
XS1576220484	ING GRO 0.75	03-22	(366) 090322	1,100,000.	M EUR	100.9481	% 30/06/20	100.88	4	1,110,428.65	1,112,279.32	2,599.32	1,850.67	0.34
XS1346815787	INTE SAN 7.0	PERP	(UST) 311299	1,000,000.	M EUR	98.2264	% 30/06/20	99.837	4	982,263.65	1,030,100.77	31,730.77	47,837.12	0.32
IT0005386245	ITALIE 0.35	02-25	(EXA) 010225	8,900,000.	M EUR	95.972	% 30/06/20	98.9085	4	8,541,511.56	8,815,793.11	12,936.61	274,281.55	2.72
IT0005127086	ITALY 2.0	12-25	(UST) 011225	9,000,000.	M EUR	102.8485	% 30/06/20	106.761	4	9,256,367.25	9,623,735.90	15,245.90	367,368.65	2.97
XS1725526765	LAND HF 1.0	05-23	(366) 300523	1,200,000.	M EUR	99.9179	% 30/06/20	98.315	4	1,199,015.09	1,180,864.93	1,084.93	-18,150.16	0.36
XS1418631930	LEAS COR 1.0	05-21	(366) 240521	1,300,000.	M EUR	101.886	% 30/06/20	99.71	4	1,324,517.67	1,297,619.04	1,389.04	-26,898.63	0.40
XS1416688890	METR 2.38	05-22	(366) 230522	1,300,000.	M EUR	107.7774	% 30/06/20	101.767	4	1,401,106.79	1,326,354.56	3,383.56	-74,752.23	0.41
XS1554112281	NIBC BA 1.5	01-22	(366) 310122	1,300,000.	M EUR	102.9996	% 30/06/20	100.936	4	1,338,995.20	1,320,319.64	8,151.64	-18,675.56	0.41
DE000A2LQ06	PBBGR 0 3/4	02/07/23	(EXA) 070223	1,300,000.	M EUR	100.761	% 30/06/20	100.0225	4	1,309,892.61	1,304,181.84	3,889.34	-5,710.77	0.40
XS1650147660	POWS KA 0.75	07-21	(366) 250721	285,000.	M EUR	101.16	% 30/06/20	99.7655	4	288,305.91	286,334.85	2,003.18	-1,971.06	0.09
XS1107890847	UNICREDIT FIX	311299	(UST) 311299	1,000,000.	M EUR	87.7981	% 30/06/20	98.394	4	877,981.36	1,004,850.33	20,910.33	126,868.97	0.31
AT0000A12GNO	VIENNA 5.5%	09/10/43	(366) 091043	1,200,000.	M EUR	120.4399	% 30/06/20	111.336	4	1,445,279.11	1,384,179.54	48,147.54	-61,099.57	0.43
XS1972547183	VOLK FI 0.625	04-22	(366) 010422	1,300,000.	M EUR	99.8896	% 30/06/20	99.4415	4	1,298,565.41	1,294,787.45	2,047.95	-3,777.96	0.40

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CUMUL (EUR)

109,850,171.68

110,279,083.07

443,341.40

428,911.39

33.99

Obligations à taux variable, révisable négo. sur u

DEVISE VALEUR : EUR EURO

XS0171467854	BES FINAN FLO	311299	(999) 311299	2,000,000.	M EUR	74.357	% 23/08/18	0.	F	1,487,139.73	0.00	0.00	-1,487,139.73	0.00
IT0005070401	UNICREDIT FLR	03-22	(EUR) 200322	550,000.	M EUR	101.7323	% 30/06/20	100.03	E	223,811.02	220,202.47	136.47	-3,608.55	0.07

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CUMUL (EUR)

1,710,950.75

220,202.47

136.47

-1,490,748.28

0.07

Obligations convertibles négo. sur un marché regl.

DEVISE VALEUR : EUR EURO

BE0933899800	FORTIS BK E3R	07-72	(UST) 311299	250,000.	M EUR	29.7299	% 30/06/20	71.082	4	74,324.70	177,846.66	141.66	103,521.96	0.05
--------------	---------------	-------	--------------	----------	-------	---------	------------	--------	---	-----------	------------	--------	------------	------

Obligations & valeurs assimilées négociés sur un marché réglementé

CUMUL (EUR)

111,635,447.13

110,677,132.20

443,619.53

-958,314.93

34.12

III - Titres d'OPCVM

OPCVM français à vocation générale

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FR0011994862	R-CO 4 CHG CL EQ I			52.	P EUR	104927.25	M 30/06/20	96131.52	5	5,456,217.00	4,998,839.04	0.00	-457,377.96	1.54
FR0011415280	R-CO CNV CV E IC EUR			20.	P EUR	115192.29	M 30/06/20	112503.09	5	2,303,845.80	2,250,061.80	0.00	-53,784.00	0.69
FR0010839555	R-CO CVICT EQ VAL I			17.	P EUR	159016.21	M 30/06/20	122507.64	5	2,703,275.57	2,082,629.88	0.00	-620,645.69	0.64
FR0011716398	R-CO EURO HY IC EUR			1,820.	P EUR	1211.39	M 30/06/20	1157.72	5	2,204,729.80	2,107,050.40	0.00	-97,679.40	0.65
FR0010784330	R-CO SELECTION EUR C			36,000.	P EUR	192.3884	M 30/06/20	181.79	5	6,925,983.60	6,544,440.00	0.00	-381,543.60	2.02
FR0011212547	RMM ACTIONS USA C			9,300.	P EUR	185.02	M 30/06/20	321.92	5	1,720,686.00	2,993,856.00	0.00	1,273,170.00	0.92

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CUMUL (EUR)

21,314,737.77

20,976,877.12

0.00

-337,860.65

6.47

## Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/20  
 PORTEFEUILLE : 1514 R-CO CONVICTION CLUB

VL VALIDEE  
 Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore  
 Devise du portefeuille : EUR

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

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>OPCVM européens coordonnés et assimilables</b>													
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
FR0013367281	R-co Valor Bal F EUR	970.	P EUR	98.5	M 30/06/20	104.96	5	95,545.00	101,811.20	0.00	6,266.20	0.03	
FR0013367356	R-co Valor Bal R EUR	9,600.	P EUR	10.	M 30/06/20	10.69	5	96,000.00	102,624.00	0.00	6,624.00	0.03	
FR0007442496	RMM COURT TERME C	807.	P EUR	3967.2177	M 30/06/20	3964.06	5	3,201,544.65	3,198,996.42	0.00	-2,548.23	0.99	
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
								CUMUL (EUR)	3,393,089.65	3,403,431.62	0.00	10,341.97	1.05
<b>III - Titres d'OPCVM</b>													
								CUMUL (EUR)	24,707,827.42	24,380,308.74	0.00	-327,518.68	7.52
<b>VI - ENGAGEMENTS SUR MARCHES A TERME</b>													
<b>Engagements à terme fermes</b>													
<b>Futures étrangers</b>													
<b>SOUS-JACENT : EUXOE EUREX BOBL EURO</b>													
COE___UO	XEUR FGBM BOB 0920	-129.	EUR	134.11	M 30/06/20	134.98	4	0.00	-112,230.00	0.00	-112,230.00	-0.03	
<b>SOUS-JACENT : EUXRX EUREX EURO BUND</b>													
CRX___UO	XEUR FGBL BUN 0920	-51.	EUR	174.28	M 30/06/20	176.52	4	0.00	-114,240.00	0.00	-114,240.00	-0.04	
<b>SOUS-JACENT : NKY TOKYO NIKKEI 225 AVERAGE</b>													
INI___UO	NK2 TOKYO NIK 0920	118.	JPY	22985.96	M 30/06/20	22260.	4	0.00	-354,977.95	0.00	-354,977.95	-0.11	
<b>SOUS-JACENT : SPX S&amp;P 500 INDEX</b>													
IES___UO	SP 500 MINI 0920	65.	USD	3118.05	M 30/06/20	3090.25	4	0.00	-80,684.05	0.00	-80,684.05	-0.02	
<b>SOUS-JACENT : TOPIX TOKYO S.E INDEX - TOPIX</b>													
ITP___UO	OSFT TOPIX IN 0920	153.	JPY	1608.9503	M 30/06/20	1558.5	4	0.00	-639,722.85	0.00	-639,722.85	-0.20	
<b>Futures étrangers</b>								CUMUL (EUR)	0.00	-1,301,854.85	0.00	-1,301,854.85	-0.40
<b>VIII - TRESORERIE</b>													
<b>Dettes et créances</b>													
<b>Coupons et dividendes en espèces</b>													
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
DE0007037129	RWE AG	98,600.	P EUR	0.589	30/06/20			58,075.40	58,075.40	0.00	0.00	0.02	
DE000PSM7770	PROSIEBEN SAT.1 MEDI	177,000.	P EUR	0.62581249	30/06/20			110,768.81	110,768.81	0.00	0.00	0.03	
FR0000120271	TOTAL	199,000.	P EUR	0.68	30/06/20			135,320.00	135,320.00	0.00	0.00	0.04	
NL0000009538	ROYAL PHILIPS	84,000.	P EUR	0.7225	30/06/20			60,690.00	60,690.00	0.00	0.00	0.02	
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>													
								CUMUL (EUR)	364,854.21	364,854.21	0.00	0.00	0.11
<b>DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING</b>													
GB0009252882	GLAXOSMITHKLINE PLC	164,000.	P GBP	0.19	30/06/20			35,211.03	34,150.56	0.00	-1,060.47	0.01	

## Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/20  
 PORTEFEUILLE : 1514 R-CO CONVICTION CLUB

VL VALIDEE  
 Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore  
 Devise du portefeuille : EUR

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

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>Coupons et dividendes en espèces</b>																		
												CUMUL (EUR)		400,065.24	399,004.77	0.00	-1,060.47	0.12
<b>Appels de marge</b>																		
<i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>																		
MARRCEUR					Appel Marge R.M.M.			226,470.	EUR	1.	30/06/20	1.		226,470.00	226,470.00	0.00	0.00	0.07
<i>DEVISE VALEUR : JPY YEN</i>																		
MARRCJPY					Appel Marge R.M.M.			120,020,598.	JPY	0.00829235	30/06/20	0.00828775		995,252.59	994,700.80	0.00	-551.79	0.31
<i>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</i>																		
MARRCUSD					Appel Marge R.M.M.			90,512.5	USD	0.88956542	30/06/20	0.89301661		80,516.79	80,829.17	0.00	312.38	0.02
<b>Appels de marge</b>																		
												CUMUL (EUR)		1,302,239.38	1,301,999.97	0.00	-239.41	0.40
<b>Frais de gestion</b>																		
<i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>																		
FGPFC1EUR					Frais de ges. var fig			-16.68	EUR	1.	30/06/20	1.		-16.68	-16.68	0.00	0.00	0.00
FGPFC2EUR					Frais de ges. var fig			-15.12	EUR	1.	30/06/20	1.		-15.12	-15.12	0.00	0.00	0.00
FGPFD1EUR					Frais de ges. var fig			-13.17	EUR	1.	30/06/20	1.		-13.17	-13.17	0.00	0.00	0.00
FGPVFC1EUR					Frais de Gest. Fixe			-130,801.8	EUR	1.	30/06/20	1.		-130,801.80	-130,801.80	0.00	0.00	-0.04
FGPVFC2EUR					Frais de Gest. Fixe			-130,332.01	EUR	1.	30/06/20	1.		-130,332.01	-130,332.01	0.00	0.00	-0.04
FGPVFC3EUR					Frais de Gest. Fixe			-17,628.07	EUR	1.	30/06/20	1.		-17,628.07	-17,628.07	0.00	0.00	-0.01
FGPVFC7EUR					Frais de Gest. Fixe			-0.26	EUR	1.	30/06/20	1.		-0.26	-0.26	0.00	0.00	0.00
FGPVFC8EUR					Frais de Gest. Fixe			-22,120.	EUR	1.	30/06/20	1.		-22,120.00	-22,120.00	0.00	0.00	-0.01
FGPVFD1EUR					Frais de Gest. Fixe			-8,977.46	EUR	1.	30/06/20	1.		-8,977.46	-8,977.46	0.00	0.00	0.00
FGPVFD4EUR					Frais de Gest. Fixe			-48.	EUR	1.	30/06/20	1.		-48.00	-48.00	0.00	0.00	0.00
FGPVFD5EUR					Frais de Gest. Fixe			-84,017.92	EUR	1.	30/06/20	1.		-84,017.92	-84,017.92	0.00	0.00	-0.03
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>																		
												CUMUL (EUR)		-393,970.49	-393,970.49	0.00	0.00	-0.12
<b>Dettes et créances</b>																		
												CUMUL (EUR)		1,308,334.13	1,307,034.25	0.00	-1,299.88	0.40
<b>Disponibilités</b>																		
<b>Avoirs en france</b>																		
<i>DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE</i>																		
BQRCCHF					ROTHSCHILD MM			390,359.15	CHF	0.94371027	30/06/20	0.93887898		368,385.94	366,500.00	0.00	-1,885.94	0.11
<i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>																		
BQRCEUR					ROTHSCHILD MM			8,695,406.04	EUR	1.	30/06/20	1.		8,695,406.04	8,695,406.04	0.00	0.00	2.68
<i>DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING</i>																		
BQRCGBP					ROTHSCHILD MM			2,644.09	GBP	0.93173455	30/06/20	1.09597449		2,463.59	2,897.86	0.00	434.27	0.00
<i>DEVISE VALEUR : JPY YEN</i>																		
BQRCJPY					ROTHSCHILD MM			319,767,160.	JPY	0.0082623	30/06/20	0.00828775		2,642,013.79	2,650,150.51	0.00	8,136.72	0.82

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/20  
 PORTEFEUILLE : 1514 R-CO CONVICTION CLUB

VL VALIDEE Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore  
 Devise du portefeuille : EUR

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

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>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</b>																			
BQRCUSD								4,433,291.26	USD	0.90287921	30/06/20	0.89301661		4,002,726.50	3,959,002.73	0.00	-43,723.77	1.22	
<b>Avoirs en france</b>																			
													CUMUL (EUR)	15,710,995.86	15,673,957.14	0.00	-37,038.72	4.83	
<b>Opérations à terme</b>																			
<b>DATE ECHEANCE : 09/07/20</b>																			
20147000952	V	JPY	EUR	09/07/20	RECU	09/07/20		2,880,635.75	EUR	1.	30/06/20	1.		2,880,635.75	2,880,635.75	0.00	0.00	0.89	
					VERSE	09/07/20		-340,000,000.	JPY	0.0085	30/06/20	0.00828732		-2,880,635.75	-2,817,687.95	0.00	62,947.80	-0.87	
PCAT107554	A	USD	EUR	09/07/20	RECU	09/07/20		5,000,000.	USD	0.9141	30/06/20	0.89278114		4,570,459.11	4,463,905.70	0.00	-106,553.41	1.38	
					VERSE	09/07/20		-4,570,459.11	EUR	1.	30/06/20	1.		-4,570,459.11	-4,570,459.11	0.00	0.00	-1.41	
PCAT107555	A	JPY	EUR	09/07/20	RECU	09/07/20		4,700,000,000.	JPY	0.0084	30/06/20	0.00828807		39,570,949.87	38,953,910.20	0.00	-617,039.67	12.01	
					VERSE	09/07/20		-39,570,949.87	EUR	1.	30/06/20	1.		-39,570,949.87	-39,570,949.87	0.00	0.00	-12.20	
PCAT108096	V	JPY	A/EUR	090720	RECU	09/07/20		3,947,037.65	EUR	1.	30/06/20	1.		3,947,037.65	3,947,037.65	0.00	0.00	1.22	
					VERSE	09/07/20		-480,450,000.	JPY	0.0082	30/06/20	0.00828736		-3,947,037.65	-3,981,662.54	0.00	-34,624.89	-1.23	
<b>SOUS TOTAL DATE ECHEANCE : 09/07/20</b>																			
													CUMUL (EUR)	0.00	-695,270.17	0.00	-695,270.17	-0.21	
<b>Disponibilités</b>																			
													CUMUL (EUR)	15,710,995.86	14,978,686.97	0.00	-732,308.89	4.62	
<b>VIII - TRESORERIE</b>																			
													CUMUL (EUR)	17,019,329.99	16,285,721.22	0.00	-733,608.77	5.02	
<b>PORTEFEUILLE : R-CO CONVICTION CLUB (1514 )</b>																			
													(EUR)	377,321,494.38	324,402,496.21	443,619.53	-52,918,998.17	100.00	



Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/20

PORTEFEUILLE : 1514 R-CO CONVICTION CLUB

VL VALIDEE

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

Devise du portefeuille : EUR

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

Portefeuille titres : 307,421,504.82 Coupons et dividendes a recevoir : 399,004.77

Frais de gestion du jour

Frais de Gest. Fixe :	4,035.88	EUR
Frais de Gest. Fixe :	4,014.33	EUR
Frais de Gest. Fixe :	0.01	EUR
Frais de Gest. Fixe :	682.9	EUR
Frais de Gest. Fixe :	277.92	EUR
Frais de Gest. Fixe :	1.49	EUR
Frais de Gest. Fixe :	2,600.58	EUR
Frais de Gest. Fixe :	551.5	EUR

Frais de gestion charge Entreprise

FRAIS MAXIMUM :	4,035.88	EUR
FRAIS MAXIMUM :	4,014.33	EUR
FRAIS MAXIMUM :	551.5	EUR
FRAIS MAXIMUM :	0.01	EUR
FRAIS MAXIMUM :	682.9	EUR
FRAIS MAXIMUM :	277.92	EUR
FRAIS MAXIMUM :	1.49	EUR
FRAIS MAXIMUM :	2,600.58	EUR

Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
C1 FR0010541557 R-CO CONVICTION CLUB C	EUR	98,800,795.31	700,944.9248	140.95	30.456339716887			147.29	140.95
C2 FR0010537423 R-CO CONVICTION CLUB F	EUR	77,324,734.34	569,963.5189	135.67	23.836391509179			141.78	135.67
C3 FR0011845692 R-CO CONVICTION CLUB P	EUR	21,246,608.16	20,804.1	1,021.27	6.549383314105			1,067.23	1,021.27
C7 FR0013111739 R-CO CONVICTION CLUB R	EUR	84.63	10.	8.46	0.000026089605			8.46	8.46
C8 FR0013293941 R-CO CONVICTION CLUB CL	EUR	19,994,607.00	141,004.0635	141.80	6.163497621111			148.18	141.80
D1 FR0010523191 R-CO CONVICTION CLUB D	EUR	6,803,665.81	66,709.2763	101.99	2.09729847389			106.58	101.99
D4 FR0013293958 R-CO CONVICTION CLUB CD	EUR	43,692.46	421.6062	103.63	0.013468548803			108.29	103.63
D5 FR0013293966 R-CO CONVICTION CLUB MF	EUR	100,188,308.50	104,480.5271	958.92	30.88359472642			1,002.07	958.92
D3 FR0012243954 PART DIST	EUR		0.00	0.	1,000.00	0.		0.00	0.00

Actif net total en EUR : 324,402,496.21

Precedente VL en date du 29/06/20 :

C1	R-CO CONVICTION CLUB C	Prec. VL :	140.76	(EUR)	Variation :	+0.135%
----	------------------------	------------	--------	-------	-------------	---------

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/20

PORTEFEUILLE : 1514 R-CO CONVICTION CLUB

VL VALIDEE

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

Devise du portefeuille : EUR

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

C2	R-CO CONVICTION CLUB F	Prec. VL :	135.48	(EUR)	Variation :	+0.140%
C3	R-CO CONVICTION CLUB P	Prec. VL :	1,019.87	(EUR)	Variation :	+0.137%
C7	R-CO CONVICTION CLUB R	Prec. VL :	8.45	(EUR)	Variation :	+0.118%
C8	R-CO CONVICTION CLUB CL	Prec. VL :	141.6	(EUR)	Variation :	+0.141%
D1	R-CO CONVICTION CLUB D	Prec. VL :	101.85	(EUR)	Variation :	+0.137%
D4	R-CO CONVICTION CLUB CD	Prec. VL :	103.49	(EUR)	Variation :	+0.135%
D5	R-CO CONVICTION CLUB MF	Prec. VL :	957.6	(EUR)	Variation :	+0.138%

Fiscalite de l'epargne : poids et statuts des parts du portefeuille

Type reporting : TIBR Revenu taxable pour residents Belges

Poids officiels et statuts en date du 01/05/20 :

Poids DD : 35.85 Statut DD : I

Poids DI : 41.42 Statut DI : M

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/20  
 PORTEFEUILLE : 1514 R-CO CONVICTION CLUB

VL VALIDEE

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

Devise du portefeuille : EUR

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

## COURS DES DEVICES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente	variation		
Cours EUR en CHF :	1.0651	cotation :	30/06/20	0.	1.0669	cotation :	29/06/20	-0.16871
Cours EUR en EUR :	1.	cotation :	30/06/20	0.	1.	cotation :	29/06/20	0.
Cours EUR en GBP :	0.91243	cotation :	30/06/20	0.	0.9154	cotation :	29/06/20	-0.32445
Cours EUR en JPY :	120.66	cotation :	30/06/20	0.	121.07	cotation :	29/06/20	-0.33865
Cours EUR en USD :	1.1198	cotation :	30/06/20	0.	1.1284	cotation :	29/06/20	-0.76214
Cours JPY en EUR :	0.0082877507	cotation :	30/06/20	0.	0.0082596845	cotation :	29/06/20	0.3398
Cours USD en EUR :	0.8930166101	cotation :	30/06/20	0.	0.8862105636	cotation :	29/06/20	0.76799

## COURS INVERSES DES DEVICES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente		
Cours CHF en EUR :	0.9388789784	cotation :	30/06/20	0.	0.9372949667	cotation :	29/06/20
Cours EUR en EUR :	1.	cotation :	30/06/20	0.	1.	cotation :	29/06/20
Cours GBP en EUR :	1.0959744857	cotation :	30/06/20	0.	1.0924186148	cotation :	29/06/20
Cours JPY en EUR :	0.0082877507	cotation :	30/06/20	0.	0.0082596844	cotation :	29/06/20
Cours USD en EUR :	0.8930166101	cotation :	30/06/20	0.	0.8862105636	cotation :	29/06/20
Cours EUR en JPY :	120.6600000649	cotation :	30/06/20	0.	121.0699997076	cotation :	29/06/20
Cours EUR en USD :	1.1198	cotation :	30/06/20	0.	1.1284	cotation :	29/06/20

# **R-CO CONVICTION CLUB**

DOCUMENT D'INFORMATION PERIODIQUE AU 30/06/2020

## 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.	285 038 321,10
b) Avoirs bancaires	15 673 957,14
c) Autres actifs détenus par l'OPC	76 326 802,78
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	377 039 081,02
e) Passif	-52 636 584,81
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	324 402 496,21

\* 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
R-CO CONVICTION CLUB P EUR	C3	21 246 608,16	20 804,10000	1 021,27
R-CO CONVICTION CLUB R EUR	C7	84,63	10,00000	8,46
R-CO CONVICTION CLUB C EUR	C1	98 800 795,31	700 944,92480	140,95
R-CO CONVICTION CLUB CL EUR	C8	19 994 607,00	141 004,06350	141,80
R-CO CONVICTION CLUB F EUR	C2	77 324 734,34	569 963,51890	135,67
R-CO CONVICTION CLUB CD EUR	D4	43 692,46	421,60620	103,63
R-CO CONVICTION CLUB MF EUR	D5	100 188 308,50	104 480,52710	958,92
R-CO CONVICTION CLUB D EUR	D1	6 803 665,81	66 709,27630	101,99

## ELEMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
<p>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.</p> <p>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.</p>	86,69	74,58
<p>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.</p>	1,18	1,01
<p>D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.</p>	0,00	0,00
<p>E) Les autres actifs.</p>	7,52	6,47

\* 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	272 344 949,84	83,95	72,23
Franc suisse	CHF	831 860,86	0,26	0,22
Livre sterling	GBP	11 861 510,40	3,66	3,15
TOTAL		285 038 321,10	87,87	75,60

\* 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	43,89	37,76
Allemagne	12,83	11,04
Italie	12,42	10,69
Pays-bas	4,87	4,19
Espagne	3,27	2,82
Royaume uni	3,09	2,66
Finlande	1,50	1,29
Luxembourg	1,27	1,09
Belgique	1,22	1,05
Autriche	1,13	0,97
Jersey	0,92	0,79
Pologne	0,46	0,40
Islande	0,36	0,31
Irlande	0,36	0,31
Suisse	0,26	0,22
TOTAL	87,87	75,60

\* 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	7,52	6,47
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
<b>Autres Actifs</b>		
Autres	0,00	0,00
TOTAL	7,52	6,47

\* 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.	92 867 779,21	139 524 510,96
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.	154 630,52	422 863,24
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.	29 731 292,44	43 850 457,63

## DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE

	Action	Montant net unitaire €	Crédit d'impôt (1) €	Montant brut unitaire (2) €
<b>Dividendes versés</b>				
27/05/2020	R-CO CONVICTION CLUB CD EUR	1,86	0,31	2,17
27/05/2020	R-CO CONVICTION CLUB MF EUR	20,44	1,87	44,63
27/05/2020	R-CO CONVICTION CLUB D EUR	1,54	0,22	1,76
<b>Dividendes à verser</b>				

(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 DETAILLE 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>ALLEMAGNE</b>				
BAYER	EUR	88 000	5 789 520,00	1,78
COMMERZBANK AG	EUR	440 000	1 745 480,00	0,54
DAIMLER AG-REGISTERED SHARES	EUR	171 000	6 180 795,00	1,91
DEUTSCHE POST AG NAMEN	EUR	145 000	4 719 750,00	1,45
DEUTSCHE TELEKOM AG	EUR	169 000	2 525 705,00	0,78
DWS GROUP GMBH & CO KGAA	EUR	42 000	1 357 020,00	0,42
HEIDELBERGER ZEMENT	EUR	66 300	3 151 902,00	0,97
HENKEL AG AND CO.KGAA NON VTG PRF	EUR	25 400	2 105 152,00	0,65
PROSIEBEN SAT.1 MEDIA N	EUR	173 000	1 832 070,00	0,56
RWE AG	EUR	98 600	3 067 446,00	0,95
SIEMENS AG-REG	EUR	62 500	6 547 500,00	2,02
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>39 022 340,00</b>	<b>12,03</b>
<b>AUTRICHE</b>				
WIENERBERGER AG	EUR	118 000	2 288 020,00	0,71
<b>TOTAL AUTRICHE</b>			<b>2 288 020,00</b>	<b>0,71</b>
<b>BELGIQUE</b>				
ANHEUSER BUSCH INBEV SA/NV	EUR	58 000	2 544 170,00	0,78
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>2 544 170,00</b>	<b>0,78</b>
<b>ESPAGNE</b>				
ATRESMEDIA	EUR	579 000	1 346 754,00	0,42
BANCO DE SABADELL S.A.	EUR	3 399 307	1 050 725,79	0,32
CAIXABANK S.A.	EUR	2 187 000	4 156 393,50	1,28
REPSOL	EUR	210 314	1 637 504,80	0,50
REPSOL SA-RTS	EUR	215 314	93 295,56	0,03
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>8 284 673,65</b>	<b>2,55</b>
<b>FINLANDE</b>				
NOKIA (AB) OYJ	EUR	980 000	3 794 070,00	1,17
<b>TOTAL FINLANDE</b>			<b>3 794 070,00</b>	<b>1,17</b>
<b>FRANCE</b>				
ACCOR	EUR	70 200	1 699 542,00	0,52
AIR FRANCE KLM	EUR	331 000	1 334 923,00	0,41
AIRBUS SE	EUR	66 400	4 217 728,00	1,30
AMUNDI	EUR	23 400	1 630 980,00	0,50
AXA	EUR	97 000	1 805 364,00	0,56
BNP PARIBAS	EUR	147 000	5 199 390,00	1,60
CAPGEMINI SE	EUR	54 600	5 566 470,00	1,72

## PORTEFEUILLE TITRES DETAILLE EN EUR (Suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CARREFOUR	EUR	270 000	3 713 850,00	1,14
CARREFOUR	EUR	5 207	71 622,29	0,02
DANONE	EUR	53 700	3 305 772,00	1,02
EDF	EUR	408 000	3 349 680,00	1,03
ILIAD	EUR	14 640	2 542 236,00	0,78
MICHELIN - CATEGORIE B	EUR	31 300	2 890 242,00	0,89
ORANGE	EUR	276 000	2 938 020,00	0,91
PEUGEOT	EUR	310 000	4 488 800,00	1,38
SAINT-GOBAIN	EUR	244 000	7 820 200,00	2,42
SANOFI	EUR	49 800	4 514 370,00	1,39
SOCIETE GENERALE SA	EUR	210 000	3 108 000,00	0,96
TOTAL	EUR	199 000	6 761 025,00	2,09
VEOLIA ENVIRONNEMENT	EUR	148 400	2 970 968,00	0,92
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>69 929 182,29</b>	<b>21,56</b>
<b>ITALIE</b>				
ASSICURAZIONI GENERALI	EUR	442 000	5 953 740,00	1,84
ENI SPA	EUR	147 000	1 248 030,00	0,38
INTESA SANPAOLO SPA	EUR	2 673 000	4 553 722,80	1,40
TELECOM ITALIA ORD SPA	EUR	10 350 000	3 619 395,00	1,12
UNICREDIT SPA	EUR	517 000	4 233 196,00	1,30
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>19 608 083,80</b>	<b>6,04</b>
<b>JERSEY</b>				
GLENCORE XSTRATA	GBP	1 596 000	2 994 937,91	0,92
<b>TOTAL JERSEY</b>			<b>2 994 937,91</b>	<b>0,92</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
ARCELORMITTAL	EUR	439 000	4 113 430,00	1,27
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>4 113 430,00</b>	<b>1,27</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
AEGON	EUR	1 707 715	4 530 567,90	1,39
ROYAL PHILIPS	EUR	84 000	3 487 680,00	1,08
STMICROELECTRONICS NV	EUR	168 000	4 065 600,00	1,25
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>12 083 847,90</b>	<b>3,72</b>
<b>PORTUGAL</b>				
BCO ESPIR SANTO E	EUR	8 000 000	0,00	0,00
<b>TOTAL PORTUGAL</b>			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>ROYAUME UNI</b>				
BALFOUR BEATTY	GBP	559 000	1 597 790,52	0,49
BARCLAYS PLC	GBP	2 332 000	2 924 360,66	0,91
BP PLC	GBP	128 663	433 186,92	0,13

## PORTEFEUILLE TITRES DETAILLE EN EUR (Suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
GLAXOSMITHKLINE PLC	GBP	139 600	2 503 965,89	0,77
PEARSON ORD	GBP	223 000	1 407 268,50	0,43
<b>TOTAL ROYAUME UNI</b>			<b>8 866 572,49</b>	<b>2,73</b>
<b>SUISSE</b>				
NOVARTIS AG NOMINATIF	CHF	10 750	831 860,86	0,26
<b>TOTAL SUISSE</b>			<b>831 860,86</b>	<b>0,26</b>
<b>TOTAL Actions &amp; val. ass. ng. sur marchés régl. ou ass.</b>			<b>174 361 188,90</b>	<b>53,74</b>
<b>TOTAL Actions et valeurs assimilées</b>			<b>174 361 188,90</b>	<b>53,74</b>
<b>Obligations et valeurs assimilées</b>				
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
PBBGR 0 3/4 02/07/23	EUR	1 300 000	1 304 181,84	0,40
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 0.625% 01-04-22	EUR	1 300 000	1 294 787,45	0,40
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>2 598 969,29</b>	<b>0,80</b>
<b>AUTRICHE</b>				
VIENNA INSURANCE GRP AGW 5.5% 09/10/43	EUR	1 200 000	1 384 179,54	0,43
<b>TOTAL AUTRICHE</b>			<b>1 384 179,54</b>	<b>0,43</b>
<b>BELGIQUE</b>				
ARGENTA SPAARBANK 1.0% 06-02-24	EUR	1 200 000	1 220 923,67	0,38
FORTIS BK TV07-191272 CV	EUR	250 000	177 846,66	0,05
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>1 398 770,33</b>	<b>0,43</b>
<b>ESPAGNE</b>				
BBVA 0.75% 11-09-22 EMTN	EUR	1 000 000	1 010 615,08	0,31
METRO 2.375% 23-05-22 EMTN	EUR	1 300 000	1 326 354,56	0,41
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>2 336 969,64</b>	<b>0,72</b>
<b>FINLANDE</b>				
FORTUM OYJ 2.25% 06/09/2022 SERIE EMTN	EUR	1 000 000	1 059 982,62	0,33
<b>TOTAL FINLANDE</b>			<b>1 059 982,62</b>	<b>0,33</b>
<b>FRANCE</b>				
ATOS SE 0.75% 07-05-22	EUR	1 000 000	1 011 045,68	0,31
BFCM 4% 22/10/2020	EUR	1 300 000	1 350 634,43	0,42
BOLLORE 2.875% 29-07-21	EUR	1 300 000	1 352 499,33	0,42
BRE 2.0% 26-11-21 EMTN	EUR	1 300 000	1 328 771,88	0,41
BURE VERI 1.25% 07-09-23	EUR	1 300 000	1 305 910,77	0,40
CARR 1.75% 15-07-22 EMTN	EUR	1 200 000	1 251 466,10	0,39
CNP ASSURANCES 1.875% 20-10-22	EUR	1 200 000	1 242 269,70	0,38
FRENCH REP 0.25% 25-11-20	EUR	62 000 000	62 292 499,40	19,20
HAVAS 1.875% 08-12-20	EUR	1 300 000	1 316 164,86	0,41
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>72 451 262,15</b>	<b>22,34</b>

## PORTEFEUILLE TITRES DETAILLE EN EUR (Suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>IRLANDE</b>				
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 0.625% 24-11-22	EUR	1 200 000	1 180 342,69	0,36
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>1 180 342,69</b>	<b>0,36</b>
<b>ISLANDE</b>				
LANDSBANKINN HF 1.0% 30-05-23	EUR	1 200 000	1 180 864,93	0,36
<b>TOTAL ISLANDE</b>			<b>1 180 864,93</b>	<b>0,36</b>
<b>ITALIE</b>				
INTESA SAN 7.0% PERP EMTN	EUR	1 000 000	1 030 100,77	0,32
ITALIE 0.35% 01-02-25	EUR	8 900 000	8 815 793,11	2,72
ITALY 2.0% 01-12-25	EUR	9 000 000	9 623 735,90	2,96
UNICREDIT E3R+2.25% 20-03-22	EUR	550 000	220 202,47	0,07
UNICREDIT SPA 6.75% PERP	EUR	1 000 000	1 004 850,33	0,31
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>20 694 682,58</b>	<b>6,38</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
ING GROEP NV 0.75% 09-03-22	EUR	1 100 000	1 112 279,32	0,34
LEASEPLAN CORPORATION NV 1.0% 24-05-21	EUR	1 300 000	1 297 619,04	0,40
NIBC BANK NV 1.5% 31-01-22	EUR	1 300 000	1 320 319,64	0,41
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>3 730 218,00</b>	<b>1,15</b>
<b>POLOGNE</b>				
BANK ZACHODNI WBK 0.75% 20-09-21	EUR	1 200 000	1 209 786,79	0,37
POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI 0.75% 25-07-21	EUR	285 000	286 334,85	0,09
<b>TOTAL POLOGNE</b>			<b>1 496 121,64</b>	<b>0,46</b>
<b>PORTUGAL</b>				
BES FINANCE LTD EURIBOR 3 MOIS REV +2.65 31/12/2099 DEFAULT	EUR	2 000 000	0,00	0,00
<b>TOTAL PORTUGAL</b>			<b>0,00</b>	<b>0,00</b>
<b>ROYAUME UNI</b>				
F 1.134 02/10/22	EUR	1 200 000	1 164 768,79	0,36
<b>TOTAL ROYAUME UNI</b>			<b>1 164 768,79</b>	<b>0,36</b>
<b>TOTAL Obligations &amp; val. ass. ng. sur mar. régl. ou ass.</b>			<b>110 677 132,20</b>	<b>34,12</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées</b>			<b>110 677 132,20</b>	<b>34,12</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>				
R-CO CONVICTION CONVERTIBLES EUROPE IC EUR	EUR	20	2 250 061,80	0,69
R-CO CONVICTION EQUITY VALUE EURO I EUR	EUR	17	2 082 629,88	0,64
R-CO EURO HIGH YIELD IC EUR	EUR	1 820	2 107 050,40	0,65
R-CO SELECTION EURO C	EUR	36 000	6 544 440,00	2,03
R-co Valor Balanced F EUR	EUR	970	101 811,20	0,03
R-co Valor Balanced R EUR	EUR	9 600	102 624,00	0,03



## PORTEFEUILLE TITRES DETAILLE EN EUR (Suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
R-CO 4CHANGE CLIMATE EQUITY EUROPE I EUR	EUR	52	4 998 839,04	1,54
RMM ACTIONS USA C	EUR	9 300	2 993 856,00	0,92
RMM COURT TERME C	EUR	807	3 198 996,42	0,99
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>24 380 308,74</b>	<b>7,52</b>
<b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>			<b>24 380 308,74</b>	<b>7,52</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>24 380 308,74</b>	<b>7,52</b>
<b>Instruments financiers à terme</b>				
<b>Engagements à terme ferme</b>				
<b>Engagements à terme ferme sur marché réglementé ou assimilé</b>				
NK2 TOKYO NIK 0920	JPY	118	-354 977,95	-0,11
OSFT TOPIX IN 0920	JPY	153	-639 722,85	-0,20
SP 500 MINI 0920	USD	65	-80 684,05	-0,02
XEUR FGBL BUN 0920	EUR	-51	-114 240,00	-0,04
XEUR FGBM BOB 0920	EUR	-129	-112 230,00	-0,03
<b>TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé</b>			<b>-1 301 854,85</b>	<b>-0,40</b>
<b>TOTAL Engagements à terme fermes</b>			<b>-1 301 854,85</b>	<b>-0,40</b>
<b>TOTAL Instruments financiers à terme</b>			<b>-1 301 854,85</b>	<b>-0,40</b>
<b>Appel de marge</b>				
MARRCEUR	EUR	226 470	226 470,00	0,07
MARRCJPY	JPY	120 020 598	994 700,80	0,31
MARRCUSD	USD	90 512,5	80 829,17	0,02
<b>TOTAL Appel de marge</b>			<b>1 301 999,97</b>	<b>0,40</b>
<b>Créances</b>			<b>50 644 494,07</b>	<b>15,61</b>
<b>Dettes</b>			<b>-51 334 729,96</b>	<b>-15,82</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>15 673 957,14</b>	<b>4,83</b>
<b>Actif net</b>			<b>324 402 496,21</b>	<b>100,00</b>

R-CO CONVICTION CLUB CD EUR	EUR	421,60620	103,63
R-CO CONVICTION CLUB P EUR	EUR	20 804,10000	1 021,27
R-CO CONVICTION CLUB R EUR	EUR	10,00000	8,46
R-CO CONVICTION CLUB D EUR	EUR	66 709,27630	101,99
R-CO CONVICTION CLUB F EUR	EUR	569 963,51890	135,67
R-CO CONVICTION CLUB CL EUR	EUR	141 004,06350	141,80
R-CO CONVICTION CLUB C EUR	EUR	700 944,92480	140,95
R-CO CONVICTION CLUB MF EUR	EUR	104 480,52710	958,92