

R-co TARGET 2024 HIGH YIELD

Société d'Investissement à Capital Variable

29, avenue de Messine
75008 Paris

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

au 30 juin 2022

R-co TARGET 2024 HIGH YIELD

Société d'Investissement à Capital Variable

29, avenue de Messine
75008 Paris

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

au 30 juin 2022

En notre qualité de commissaire aux comptes de la SICAV R-co TARGET 2024 HIGH YIELD 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 au 30 juin 2022 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 2022

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés

Olivier GALIENNE

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

(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

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

DE000A254YS5	ACCE RE 3.625 02-23	(UST)	130223	4,000,000.	M EUR	97.4699	%	30/06/22	70.3	4	3,898,795.21	2,868,477.90	56,477.90	-1,030,317.31	0.98
XS1468662801	ADIE GL 3.5 08-24	(UST)	150824	6,098,000.	M EUR	93.5134	%	30/06/22	90.4345	4	5,702,449.89	5,596,648.21	81,952.40	-105,801.68	1.92
XS1647815775	ADRI BI 4.875 07-24	(EUR)	010724	5,800,000.	M EUR	104.3262	%	30/06/22	91.137	4	6,050,918.48	5,418,681.42	132,735.42	-632,237.06	1.86
FR0013477254	AIR FR 1.875 01-25	(366)	160125	4,500,000.	M EUR	91.5634	%	30/06/22	84.503	4	4,120,351.37	3,841,701.78	39,066.78	-278,649.59	1.32
XS2054539627	ALTI FR 2.5 01-25	(EUR)	150125	6,600,000.	M EUR	101.0396	%	30/06/22	87.637	4	6,668,613.81	5,820,250.33	36,208.33	-848,363.48	1.99
XS1586831999	ARAM IN 3.125 04-25	(EUR)	010425	6,600,000.	M EUR	103.4283	%	30/06/22	89.942	4	6,826,268.68	5,989,453.25	53,281.25	-836,815.43	2.05
XS1576621632	AVIS BU 4.5 05-25	(EUR)	150525	6,300,000.	M EUR	101.1979	%	30/06/22	93.5365	4	6,375,464.60	5,931,387.00	38,587.50	-444,077.60	2.03
XS1492656787	AXAL CO 3.75 01-25	(EUR)	150125	4,500,000.	M EUR	103.6253	%	30/06/22	90.76	4	4,663,140.42	4,163,418.75	79,218.75	-499,721.67	1.43
XS2112340679	BANI EN 3.5 03-25	(EUR)	010325	6,100,000.	M EUR	99.2904	%	30/06/22	89.5325	4	6,056,716.62	5,534,428.33	72,945.83	-522,288.29	1.90
FR0013469285	BERT CO 4.5 12-24	(999)	201224	4,100,000.	M EUR	100.1793	%	30/06/22	93.021	E	4,107,350.00	3,914,823.50	100,962.50	-192,526.50	1.34
XS1811024543	CE ENER 1.659 04-24	(366)	260424	6,000,000.	M EUR	89.3764	%	30/06/22	85.261	4	5,362,586.14	5,134,477.15	18,817.15	-228,108.99	1.76
XS1227287221	CROW EUR 3.38 05-25	(360)	150525	2,500,000.	M EUR	102.3681	%	30/06/22	96.927	4	2,559,203.13	2,434,659.38	11,484.38	-124,543.75	0.83
XS2363244513	DEUT LU 2.0 07-24	(366)	140724	6,100,000.	M EUR	99.283	%	30/06/22	93.7655	4	6,056,263.00	5,838,353.03	118,657.53	-217,909.97	2.00
XS1841967356	DKT FIN 7.0 06-23	(EUR)	170623	4,600,000.	M EUR	103.158	%	30/06/22	95.27	4	4,745,267.78	4,397,625.56	15,205.56	-347,642.22	1.51
XS1699848914	DUFR FI 2.5 12-24	(EUR)	311224	6,200,000.	M EUR	99.3209	%	30/06/22	90.985	4	6,157,898.84	5,675,083.89	34,013.89	-482,814.95	1.95
XS1992087996	EG GLOB 4.375 02-25	(EUR)	070225	6,000,000.	M EUR	99.143	%	30/06/22	89.538	4	5,948,582.16	5,408,009.17	35,729.17	-540,572.99	1.85
FR0013461274	ERAMET 5.875 05-25	(366)	210525	5,700,000.	M EUR	101.5828	%	30/06/22	99.5255	4	5,790,217.53	5,713,321.99	40,368.49	-76,895.54	1.96
XS1785467751	FAUR 2.625 06-25	(EUR)	150625	4,624,000.	M EUR	101.3772	%	30/06/22	86.705	4	4,687,679.97	4,015,645.37	6,406.17	-672,034.60	1.38
FI4000507132	FINNAIR 4.25 05-25	(EUR)	190525	5,500,000.	M EUR	100.4948	%	30/06/22	83.0195	4	5,527,215.18	4,595,291.25	29,218.75	-931,923.93	1.58
XS1767930586	FORD MO 1.355 02-25	(366)	070225	5,000,000.	M EUR	97.5297	%	30/06/22	88.948	4	4,876,486.63	4,474,685.62	27,285.62	-401,801.01	1.53
XS2060691719	HELL PE 2.0 10-24	(UST)	041024	6,000,000.	M EUR	101.4402	%	30/06/22	95.416	4	6,086,409.63	5,754,796.07	29,836.07	-331,613.56	1.97
XS1764706310	HLD EUR 4.0 12-23	(999)	191223	1,400,000.	M EUR	104.0075	%	30/06/22	97.9535	E	1,456,105.56	1,401,993.44	30,644.44	-54,112.12	0.48
FR0013331196	ILIAD 1.875 04-25	(366)	250425	5,100,000.	M EUR	99.7144	%	30/06/22	90.5325	4	5,085,435.37	4,635,496.54	18,339.04	-449,938.83	1.59
XS2114146181	IM GROU 6.625 03-25	(EUR)	010325	5,100,000.	M EUR	101.4558	%	30/06/22	100.062	E	5,174,244.36	5,205,463.04	102,301.04	31,218.68	1.78
XS2322423455	INTL CO 2.75 03-25	(366)	250325	6,600,000.	M EUR	99.8573	%	30/06/22	85.069	4	6,590,584.93	5,664,777.29	50,223.29	-925,807.64	1.94
XS1844997970	INTL GA 3.5 07-24	(EUR)	150724	6,000,000.	M EUR	103.77	%	30/06/22	97.86	4	6,226,202.74	5,970,183.33	98,583.33	-256,019.41	2.05
XS1634532748	INTR JU 3.125 07-24	(EUR)	150724	6,200,000.	M EUR	99.8225	%	30/06/22	92.739	4	6,188,992.86	5,840,772.86	90,954.86	-348,220.00	2.00
XS1551347393	JAGU LA 2.2 01-24	(EUR)	150124	2,100,000.	M EUR	90.1261	%	30/06/22	90.588	4	1,892,648.76	1,924,036.33	21,688.33	31,387.57	0.66
XS2010037849	JAGU LA 5.875 11-24	(EUR)	151124	4,500,000.	M EUR	104.6803	%	30/06/22	92.2915	4	4,710,612.92	4,189,101.88	35,984.38	-521,511.04	1.44
DE000A2NB965	KAEF IS 5.5 01-24	(EUR)	100124	5,100,000.	M EUR	102.6423	%	30/06/22	98.2785	4	5,234,758.89	5,147,778.50	135,575.00	-86,980.39	1.76
XS1605600532	LA FINA 4.0 05-24	(EUR)	150524	3,200,000.	M EUR	92.8587	%	30/06/22	77.689	4	2,971,479.12	2,503,470.22	17,422.22	-468,008.90	0.86
XS1820759147	LA FINA 5.125 05-25	(EUR)	150525	3,600,000.	M EUR	82.2809	%	30/06/22	76.9745	4	2,962,113.27	2,780,819.50	9,737.50	-181,293.77	0.95
XS1990952779	LHMC FI 4.75 05-25	(EUR)	220525	5,500,000.	M EUR	101.9756	%	30/06/22	88.884	4	5,608,658.11	4,898,779.72	10,159.72	-709,878.39	1.68
XS1974797364	LINC FA 3.625 04-24	(EUR)	010424	6,000,000.	M EUR	100.8423	%	30/06/22	96.9625	4	6,050,538.62	5,873,937.50	56,187.50	-176,601.12	2.01
XS2031870921	LOXA SA 3.25 01-25	(USA)	140125	2,750,000.	M EUR	101.3781	%	30/06/22	90.4245	4	2,787,898.55	2,513,734.51	27,060.76	-274,164.04	0.86
XS1590067432	LOXAM 6.0 04-25	(EUR)	150425	4,250,000.	M EUR	106.8459	%	30/06/22	92.486	4	2,266,362.38	1,989,695.59	27,928.48	-276,666.79	0.68
XS2312156115	LSF9 BA 7.75 12-24	(EUR)	311224	3,000,000.	M EUR	100.9565	%	30/06/22	94.8085	4	3,028,694.45	2,944,442.62	71,115.38	-84,251.83	1.01
XS2166184916	MOTI FI 7.0 05-25	(EUR)	150525	5,500,000.	M EUR	107.8831	%	30/06/22	94.964	4	5,933,567.82	5,275,422.78	52,402.78	-658,145.04	1.81
XS1690644668	NIDD HE 3.5 09-24	(EUR)	300924	5,500,000.	M EUR	101.5141	%	30/06/22	88.873	4	5,583,275.46	4,938,278.89	50,263.89	-644,996.57	1.69
XS1713466222	NOVA 5.0 06-25	(EUR)	150625	5,000,000.	M EUR	92.7791	%	30/06/22	65.676	4	4,638,956.41	3,296,994.44	13,194.44	-1,341,961.97	1.13
PTNOB10M0014	NOVO BA 3.5 07-24	(366)	230724	4,000,000.	M EUR	99.3396	%	30/06/22	94.146	4	3,973,583.50	3,898,552.33	132,712.33	-75,031.17	1.34
XS2077666316	OI EURO 2.875 02-25	(EUR)	150225	6,300,000.	M EUR	102.5819	%	30/06/22	90.972	4	6,462,660.63	5,801,170.37	69,934.38	-661,490.26	1.99
XS1794209459	PAPREC 4.0 03-25	(EUR)	310325	6,600,000.	M EUR	95.2646	%	30/06/22	87.545	4	6,287,465.54	5,868,170.00	90,200.00	-419,295.54	2.01

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
XS2010038060	PEAC PR 3.5	02-23	(UST) 150223	2,000,000.	M EUR	87.2375	% 30/06/22	85.8295	4	1,744,750.00	1,726,100.87	9,510.87	-18,649.13	0.59
XS1735583095	PLAT 14 5.375	06-23	(EUR) 150623	6,120,000.	M EUR	101.7056	% 30/06/22	96.523	4	6,224,379.68	5,924,568.85	17,361.25	-299,810.83	2.03
XS2078976805	PPF ARE 2.125	01-25	(366) 310125	2,500,000.	M EUR	99.7967	% 30/06/22	92.945	4	2,494,916.94	2,346,039.38	22,414.38	-148,877.56	0.80
XS2115189875	QPAR HO 1.5	03-25	(EUR) 010325	5,500,000.	M EUR	96.5886	% 30/06/22	86.8915	4	5,312,374.99	4,807,220.00	28,187.50	-505,154.99	1.65
FR0013478849	QUAD 2.25	02-25	(366) 030225	2,300,000.	M EUR	99.413	% 30/06/22	93.6175	4	2,286,499.00	2,174,611.40	21,408.90	-111,887.60	0.75
XS2107451069	RCS RDS 2.5	02-25	(EUR) 050225	6,000,000.	M EUR	99.8417	% 30/06/22	88.3205	4	5,990,500.00	5,361,313.33	62,083.33	-629,186.67	1.84
FR0013428414	RENA 1.25	06-25	(366) 240625	3,000,000.	M EUR	88.0371	% 30/06/22	87.0275	4	2,641,113.70	2,611,852.40	1,027.40	-29,261.30	0.90
XS2178048257	RUBI TE 5.625	05-25	(EUR) 150525	6,100,000.	M EUR	107.0761	% 30/06/22	97.026	4	6,531,641.14	5,965,289.13	46,703.13	-566,352.01	2.04
XS2010038904	SAZK GR 4.125	11-24	(EUR) 201124	6,700,000.	M EUR	103.7955	% 30/06/22	95.2625	4	6,954,301.09	6,416,366.67	33,779.17	-537,934.42	2.20
XS2070055095	SCHOPA 6 3/8	11/01/2	(EUR) 011124	5,700,000.	M EUR	102.354	% 30/06/22	84.413	4	5,834,179.02	4,875,131.63	63,590.63	-959,047.39	1.67
XS2325693369	SCYRSM 3 1/4	04/02/2	(EXA) 020424	3,000,000.	M EUR	100.6617	% 30/06/22	99.1715	E	3,019,851.97	3,000,788.84	25,643.84	-19,063.13	1.03
XS2361253862	SOFT GR 2.125	07-24	(UST) 060724	6,200,000.	M EUR	100.058	% 30/06/22	90.296	4	6,203,596.93	5,663,499.10	65,147.10	-540,097.83	1.94
XS1814546013	TELE CO 3.875	05-25	(EUR) 020525	5,450,000.	M EUR	99.0788	% 30/06/22	84.151	4	5,399,795.49	4,622,600.68	36,371.18	-777,194.81	1.58
FR0013183571	TEREOS 4.13	06-23	(366) 160623	3,000,000.	M EUR	92.4727	% 30/06/22	99.492	4	2,774,181.02	2,990,862.74	6,102.74	216,681.72	1.03
XS1813724603	TEVA PH 4.25	03-25	(EUR) 010325	2,500,000.	M EUR	106.1	% 30/06/22	93.7975	4	2,652,500.00	2,383,375.00	38,437.50	-269,125.00	0.82
XS2198213956	TEVA PH 6.0	01-25	(EUR) 310125	3,500,000.	M EUR	110.7685	% 30/06/22	97.8005	4	3,876,898.15	3,512,850.83	89,833.33	-364,047.32	1.20
XS1707063589	WEBUILD 1.75	10-24	(366) 261024	6,000,000.	M EUR	85.2452	% 30/06/22	91.517	4	5,114,714.77	5,563,225.48	72,205.48	448,510.71	1.91
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO														
CUMUL (EUR)										288,438,913.21	265,029,986.96	2,910,880.26	-23,408,926.25	90.84
Obligations à taux variable, révisable nég. sur u														
DEVISE VALEUR : EUR EURO														
XS2085860844	ASSE FINA FLR	05-25	(999) 150525	5,380,000.	M EUR	102.1451	% 30/06/22	96.778	E	5,495,405.30	5,220,853.62	14,197.22	-274,551.68	1.79
FR0011765825	CASI GUIC FLR	03-24	(366) 070324	6,000,000.	M EUR	91.7662	% 30/06/22	80.853	4	5,505,974.57	4,939,168.27	87,988.27	-566,806.30	1.69
XS2010032295	VERI HLD A FLR	04-25	(999) 150425	5,650,000.	M EUR	101.535	% 30/06/22	97.192	4	5,736,729.17	5,554,125.78	62,777.78	-182,603.39	1.90
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO														
CUMUL (EUR)										16,738,109.04	15,714,147.67	164,963.27	-1,023,961.37	5.39
Obligations & valeurs assimilées négociés sur un marché réglementé														
CUMUL (EUR)										305,177,022.25	280,744,134.63	3,075,843.53	-24,432,887.62	96.23
III - Titres d'OPCVM														
OPCVM européens coordonnés et assimilables														
DEVISE VALEUR : EUR EURO														
FR0007442496	RMM COURT TERME	C		3,002.	P EUR	3924.4137	M 30/06/22	3917.38	5	11,781,089.86	11,759,974.76	0.00	-21,115.10	4.03
VIII - TRESORERIE														
Dettes et créances														
Règlements différés														
DEVISE VALEUR : EUR EURO														
ARDEUR	Ach rglé différé			-307,308.84	EUR	1.	30/06/22	1.		-307,308.84	-307,308.84	0.00	0.00	-0.11
RACHEUR	Rachats a payer			-219,152.88	EUR	1.	30/06/22	1.		-219,152.88	-219,152.88	0.00	0.00	-0.08
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO														
CUMUL (EUR)										-526,461.72	-526,461.72	0.00	0.00	-0.18

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/22

Devise de fixing : BCE Devise BCE on shore

PORTEFEUILLE : 640048 R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD

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	
Frais de gestion																	
DEVISE VALEUR : EUR EURO																	
FGPVFC1EUR	Frais de Gest. Fixe			-133,833.63	EUR	1.	30/06/22	1.			-133,833.63	-133,833.63		0.00	0.00	-0.05	
FGPVFC2EUR	Frais de Gest. Fixe			-911.11	EUR	1.	30/06/22	1.			-911.11	-911.11		0.00	0.00	0.00	
FGPVFC4EUR	Frais de Gest. Fixe			-51,335.99	EUR	1.	30/06/22	1.			-51,335.99	-51,335.99		0.00	0.00	-0.02	
FGPVFD1EUR	Frais de Gest. Fixe			-7,124.55	EUR	1.	30/06/22	1.			-7,124.55	-7,124.55		0.00	0.00	0.00	
FGPVFD3EUR	Frais de Gest. Fixe			-35,387.36	EUR	1.	30/06/22	1.			-35,387.36	-35,387.36		0.00	0.00	-0.01	
FGPVFD4EUR	Frais de Gest. Fixe			-8,350.05	EUR	1.	30/06/22	1.			-8,350.05	-8,350.05		0.00	0.00	0.00	
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO																	
											CUMUL (EUR)	-236,942.69	-236,942.69	0.00	0.00	-0.08	
Dettes et créances																	
											CUMUL (EUR)	-763,404.41	-763,404.41	0.00	0.00	-0.26	
Disponibilités																	
Avoirs en france																	
DEVISE VALEUR : EUR EURO																	
BQRCEUR	ROTHSCHILD MM			3,127.25	EUR	1.	30/06/22	1.			3,127.25	3,127.25		0.00	0.00	0.00	
VIII - TRESORERIE																	
											CUMUL (EUR)	-760,277.16	-760,277.16	0.00	0.00	-0.26	
PORTEFEUILLE : R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD (640048)																	
											(EUR)	316,197,834.95	291,743,832.23	3,075,843.53	-24,454,002.72	100.00	

Portefeuille titres :		292,504,109.39							
<u>Frais de gestion du jour</u>									
Frais de Gest. Fixe :	3,844.14	EUR							
Frais de Gest. Fixe :	25.82	EUR							
Frais de Gest. Fixe :	1,453.34	EUR							
Frais de Gest. Fixe :	202.72	EUR							
Frais de Gest. Fixe :	1,003.44	EUR							
Frais de Gest. Fixe :	236.97	EUR							
<u>Frais de gestion charge Entreprise</u>									
FRAIS MAXIMUM :	3,844.14	EUR							
FRAIS MAXIMUM :	25.82	EUR							
FRAIS MAXIMUM :	1,453.34	EUR							
FRAIS MAXIMUM :	202.72	EUR							
FRAIS MAXIMUM :	1,003.44	EUR							
FRAIS MAXIMUM :	236.97	EUR							
Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
C1 FR0013269412 R-CO TA 2024 HY CEUR EUR		140,307,087.94	1,402,847.882	100.02	48.092765782229			102.52	100.02
C2 FR0013269438 R-CO TA 2024 HY FEUR EUR		785,215.45	7,879.374	99.65	0.269148127948			102.14	99.65
C4 FR0013269453 R-CO TA 2024 HYICEUR EUR		106,092,244.96	103,709.497	1,022.98	36.364517772513			1,048.55	1,022.98
D1 FR0013269420 R-CO TA 2024 HY DEUR EUR		7,399,029.26	83,716.565	88.38	2.536149717397			90.59	88.38
D3 FR0013269503 R-CO TA 2024 HYNMKDE EUR		27,331,440.13	311,527.856	87.73	9.368427586204			89.92	87.73
D4 FR0013269511 R-CO TA 2024 HY NMKI EUR		9,828,814.49	11,176.963	879.38	3.368991013709			901.36	879.38
C3 FR0013269446 R-CO TAT 2024 HYREUR EUR		0.00	0.	100.00	0.			0.00	0.00
C5 FR0013269487 R-CO TA 2024 HYICHFH EUR		0.00	0.	1,000.00	0.			0.00	0.00
C6 FR0013269495 R-CO TAT 24 HYPCHFH EUR		0.00	0.	100.00	0.			0.00	0.00
D2 FR0013269479 R-CO TA 2024 HYIDEUR EUR		0.00	0.	1,000.00	0.			0.00	0.00
Actif net total en EUR :		291,743,832.23							
Precedente VL en date du 29/06/22 :									
C1	R-CO TA 2024 HY CEUR	Prec. VL :	100.65	(EUR)	Variation :	-0.626%			
C2	R-CO TA 2024 HY FEUR	Prec. VL :	100.28	(EUR)	Variation :	-0.628%			
C4	R-CO TA 2024 HYICEUR	Prec. VL :	1,029.41	(EUR)	Variation :	-0.625%			
D1	R-CO TA 2024 HY DEUR	Prec. VL :	88.94	(EUR)	Variation :	-0.630%			

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/22

PORTEFEUILLE : 640048 R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD

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 : BVAL04)

D3	R-CO TA 2024 HYNMKDE	Prec. VL :	88.29	(EUR)	Variation :	-0.634%
D4	R-CO TA 2024 HY NMKI	Prec. VL :	884.92	(EUR)	Variation :	-0.626%

VL theorique

Part	Devise	Actif theorique	Valeur liquidative theorique
C1 FR0013269412 R-CO TA 2024 HY CEUR	EUR	140,307,087.94	100.02
C2 FR0013269438 R-CO TA 2024 HY FEUR	EUR	785,215.45	99.65
C4 FR0013269453 R-CO TA 2024 HYICEUR	EUR	106,092,244.96	1,022.98
D1 FR0013269420 R-CO TA 2024 HY DEUR	EUR	7,399,029.26	88.38
D3 FR0013269503 R-CO TA 2024 HYNMKDE	EUR	27,331,440.13	87.73
D4 FR0013269511 R-CO TA 2024 HYNMKI	EUR	9,828,814.49	879.38

Actif theorique total en EUR : 291,743,832.23 (Sens collecte : EQU)

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

Type reporting : TIBR Revenu taxable pour résidents Belges

Poids officiels et statuts en date du 01/05/22 :

Poids DD : 97.94 Statut DD : 0

Poids DI : 100. Statut DI : M

Type reporting : TISF TIS France

Poids officiels et statuts en date du 30/06/22 :

Poids DD :	96.21	Statut DD :	I
------------	-------	-------------	---

Poids DI : 100. Statut DI : M

Poids non officiels en date du 30/06/22 :

Poids DD : 96.21

Poids DI : 100.

- Poids calcule de 0. % (pour un seuil de 0. %)

R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD

DOCUMENT D'INFORMATION PÉRIODIQUE AU 30/06/2022

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	280 744 134,63
b) Avoirs bancaires	3 127,25
c) Autres actifs détenus par l'OPC	11 759 974,76
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	292 507 236,64
e) Passif	-763 404,41
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	291 743 832,23

* 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 TARGET 2024 HIGH YIELD C EUR en EUR	C	140 307 087,94	1 402 847,882	100,02
R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD D EUR en EUR	D	7 399 029,26	83 716,565	88,38
R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD F EUR en EUR	C	785 215,45	7 879,374	99,65
R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD IC EUR en EUR	C	106 092 244,96	103 709,497	1 022,98
R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD NAGELMACKERS D EUR en EUR	D	27 331 440,13	311 527,856	87,73
R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD NAGELMACKERS ID EUR en EUR	D	9 828 814,49	11 176,963	879,38

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.	80,84	80,62
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.	15,39	15,35
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.	4,03	4,02

* 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	280 744 134,63	96,23	95,98
TOTAL		280 744 134,63	96,23	95,98

* 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	26,99	26,92
PAYS-BAS	11,69	11,66
LUXEMBOURG	10,71	10,69
ALLEMAGNE	10,65	10,62
ROYAUME-UNI	10,00	9,97
SUEDE	5,70	5,68
REPUBLIQUE TCHEQUE	3,96	3,95
ESPAGNE	2,97	2,96
JAPON	1,94	1,94
JERSEY	1,92	1,91
ITALIE	1,91	1,90
ROUMANIE	1,84	1,83
FINLANDE	1,58	1,57
ETATS-UNIS	1,53	1,53
DANEMARK	1,51	1,50
PORTUGAL	1,34	1,33
TOTAL	96,23	95,98

* 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	4,03	4,02
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	4,03	4,02

* 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.	22 323 158,35	58 356 787,51
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.	0,00	18 912 578,82
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.	28 725 033,70	27 543 670,01

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Action	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt (1) EUR	Montant brut unitaire (2) EUR
Dividendes versés				
25/02/2022	R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD D EUR	3,22	0,00	3,22
25/02/2022	R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD NAGELMACKERS ID EUR	33,27	0,00	33,27
25/02/2022	R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD NAGELMACKERS D EUR	2,87	0,00	2,87
Dividendes à verser				
	R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD D EUR			
	R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD NAGELMACKERS D EUR			
	R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD NAGELMACKERS ID EUR			

(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 30/06/2022 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				
ACCENTRO REAL ESTATE AG 3.625% 13-02-23	EUR	4 000 000	2 868 477,90	0,98
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2.0% 14-07-24	EUR	6 100 000	5 838 353,03	2,00
KAEFER ISOLIERTECHNIK GMBH CO KG 5.5% 10-01-24	EUR	5 100 000	5 147 778,50	1,77
NIDDA HEALTHCARE HOLDING 3.5% 30-09-24	EUR	5 500 000	4 938 278,89	1,68
PEACH PROPERTY FINANCE GMBH 3.5% 15-02-23	EUR	2 000 000	1 726 100,87	0,60
PLATIN 1426 GMBH 5.375% 15-06-23	EUR	6 120 000	5 924 568,85	2,03
TELE COLUMBUS AG 3.875% 02-05-25	EUR	5 450 000	4 622 600,68	1,58
TOTAL ALLEMAGNE			31 066 158,72	10,64
DANEMARK				
DKT FINANCE APS 7.0% 17-06-23	EUR	4 600 000	4 397 625,56	1,51
TOTAL DANEMARK			4 397 625,56	1,51
ESPAGNE				
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROU 2.75% 25-03-25	EUR	6 600 000	5 664 777,29	1,94
SCYRSM 3 1/4 04/02/24	EUR	3 000 000	3 000 788,84	1,03
TOTAL ESPAGNE			8 665 566,13	2,97
ETATS-UNIS				
FORD MOTOR CREDIT 1.355% 07-02-25	EUR	5 000 000	4 474 685,62	1,53
TOTAL ETATS-UNIS			4 474 685,62	1,53
FINLANDE				
FINNAIR 4.25% 19-05-25	EUR	5 500 000	4 595 291,25	1,58
TOTAL FINLANDE			4 595 291,25	1,58
FRANCE				
AIR FR KLM 1.875% 16-01-25	EUR	4 500 000	3 841 701,78	1,32
ALTICE FRANCE 2.5% 15-01-25	EUR	6 600 000	5 820 250,33	2,00
BANIJAY ENTERTAINMENT SASU 3.5% 01-03-25	EUR	6 100 000	5 534 428,33	1,89
BERTRAND CORP 4.5% 20-12-24	EUR	4 100 000	3 914 823,50	1,35
CASINO GUICHARD PERRACHON 4.498% 07-03-24	EUR	6 000 000	4 939 168,27	1,69
CROW EURO HOL 3.375% 15-05-25	EUR	2 500 000	2 434 659,38	0,84
ERAMET 5.875% 21-05-25	EUR	5 700 000	5 713 321,99	1,96
FAURECIA 2.625% 15-06-25	EUR	4 624 000	4 015 645,37	1,37
ILIAD 1.875% 25-04-25	EUR	5 100 000	4 635 496,54	1,59
IM GROUP SAS 6.625% 01-03-25	EUR	5 100 000	5 205 463,04	1,79
LA FINANCIERE ATALIAN 4.0% 15-05-24	EUR	3 200 000	2 503 470,22	0,86
LA FINANCIERE ATALIAN 5.125% 15-05-25	EUR	3 600 000	2 780 819,50	0,95
LOXAM 6.0% 15-04-25	EUR	4 250 000	1 989 695,59	0,68
LOXAM SAS 3.25% 14-01-25	EUR	2 750 000	2 513 734,51	0,86
NOVAFIVES 5.0% 15-06-25	EUR	5 000 000	3 296 994,44	1,13
PAPREC 4.0% 31-03-25	EUR	6 600 000	5 868 170,00	2,01
QUADIENT 2.25% 03-02-25	EUR	2 300 000	2 174 611,40	0,74
RENAULT 1.25% 24-06-25 EMTN	EUR	3 000 000	2 611 852,40	0,89
RUBIS TERMINAL INFRA SAS 5.625% 15-05-25	EUR	6 100 000	5 965 289,13	2,05
TEREOS 4.125% 16-06-23	EUR	3 000 000	2 990 862,74	1,02

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2022 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TOTAL FRANCE			78 750 458,46	26,99
ITALIE				
WEBUILD SPA 1.75% 26-10-24	EUR	6 000 000	5 563 225,48	1,91
TOTAL ITALIE			5 563 225,48	1,91
JAPON				
SOFTBANK GROUP 2.125% 06-07-24	EUR	6 200 000	5 663 499,10	1,94
TOTAL JAPON			5 663 499,10	1,94
JERSEY				
ADIE GLOB HOL 3.5% 15-08-24	EUR	6 098 000	5 596 648,21	1,92
TOTAL JERSEY			5 596 648,21	1,92
LUXEMBOURG				
ARAMARK INTERNATIONAL FINANCE SARL 3.125% 01-04-25	EUR	6 600 000	5 989 453,25	2,05
HLD EUROPE SCA 4.0% 19-12-23	EUR	1 400 000	1 401 993,44	0,48
LHMC FINCO SARL 4.75% 22-05-25	EUR	5 500 000	4 898 779,72	1,68
LINCOLN FINANCING SARL 3.625% 01-04-24	EUR	6 000 000	5 873 937,50	2,01
LSF9 BALTA ISSUER 7.75% 31-12-24	EUR	3 000 000	2 944 442,62	1,01
MOTION FINCO SARL 7.0% 15-05-25	EUR	5 500 000	5 275 422,78	1,81
SCHOPA 6 3/8 11/01/24	EUR	5 700 000	4 875 131,63	1,67
TOTAL LUXEMBOURG			31 259 160,94	10,71
PAYS-BAS				
ADRIA BIDCO BV 4.875% 01-07-24	EUR	5 800 000	5 418 681,42	1,86
AXAL COAT 3.75% 15-01-25	EUR	4 500 000	4 163 418,75	1,43
DUFY ONE B.V 2.5% 31-12-24	EUR	6 200 000	5 675 083,89	1,95
OI EUROPEAN GROUP BV 2.875% 15-02-25	EUR	6 300 000	5 801 170,37	1,99
PPF ARENA 2.125% 31-01-25 EMTN	EUR	2 500 000	2 346 039,38	0,80
QPARK HOLDING I BV 1.5% 01-03-25	EUR	5 500 000	4 807 220,00	1,65
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.25% 01-03-25	EUR	2 500 000	2 383 375,00	0,81
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 6.0% 31-01-25	EUR	3 500 000	3 512 850,83	1,20
TOTAL PAYS-BAS			34 107 839,64	11,69
PORTUGAL				
NOVO BAN 3.5% 23-07-24	EUR	4 000 000	3 898 552,33	1,34
TOTAL PORTUGAL			3 898 552,33	1,34
REPUBLIQUE TCHEQUE				
CE ENERGY AS 1.659% 26-04-24	EUR	6 000 000	5 134 477,15	1,76
SAZKA GROUP AS 4.125% 20-11-24	EUR	6 700 000	6 416 366,67	2,20
TOTAL REPUBLIQUE TCHEQUE			11 550 843,82	3,96
ROUMANIE				
RCS RDS 2.5% 05-02-25	EUR	6 000 000	5 361 313,33	1,84
TOTAL ROUMANIE			5 361 313,33	1,84
ROYAUME-UNI				
AVIS BUDGET FINANCE PLC 4.5% 15-05-25	EUR	6 300 000	5 931 387,00	2,03
EG GLOBAL FINANCE PLC 4.375% 07-02-25	EUR	6 000 000	5 408 009,17	1,86
HELLENIC PETROLEUM FINANCE 2.0% 04-10-24	EUR	6 000 000	5 754 796,07	1,97
INTL GAME TECHNOLOGY 3.5% 15-07-24	EUR	6 000 000	5 970 183,33	2,04
JAGUAR LAND ROVER 5.875% 15-11-24	EUR	4 500 000	4 189 101,88	1,44
JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE 2.2% 15-01-24	EUR	2 100 000	1 924 036,33	0,66

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2022 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TOTAL ROYAUME-UNI			29 177 513,78	10,00
SUEDE				
ASSEMBLIN FINANCING E3R+5.0% 15-05-25	EUR	5 380 000	5 220 853,62	1,79
INTRUM JUSTITIA AB 3.125% 15-07-24	EUR	6 200 000	5 840 772,86	2,01
VERISURE HLD AB E3R+5.0% 15-04-25	EUR	5 650 000	5 554 125,78	1,90
TOTAL SUEDE			16 615 752,26	5,70
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			280 744 134,63	96,23
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			280 744 134,63	96,23
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	3 002	11 759 974,76	4,03
TOTAL FRANCE			11 759 974,76	4,03
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			11 759 974,76	4,03
TOTAL Organismes de placement collectif			11 759 974,76	4,03
Dettes			-763 404,41	-0,26
Comptes financiers			3 127,25	0,00
Actif net			291 743 832,23	100,00

Parts R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD C EUR	EUR	1 402 847,882	100,02
Parts R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD D EUR	EUR	83 716,565	88,38
Parts R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD F EUR	EUR	7 879,374	99,65
Parts R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD IC EUR	EUR	103 709,497	1 022,98
Parts R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD NAGELMACKERS D EUR	EUR	311 527,856	87,73
Parts R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD NAGELMACKERS ID EUR	EUR	11 176,963	879,38