

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 2023

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 2023

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 2023 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 2023

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés


Olivier GALIENNE

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

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

I - Obligations & Valeurs assimilées

Obligations & valeurs assimilées négociés sur un marché réglementé

Obligations à taux fixe nég. sur un marché regl.

DEVISE VALEUR : EUR EURO

DE000A254YS5 ACCE RE 3. 625 02-26	(UST) 130226	3,000,000.	M EUR	97.8069	% 30/06/23	60.649	4	2,640,787.25	1,696,678.73	59,155.73	-944,108.52	0.60
FR0013233384 ACCOR 2. 5 01-24	(366) 250124	4,100,000.	M EUR	99.2522	% 30/06/23	99.029	4	4,069,339.10	4,105,120.51	44,931.51	35,781.41	1.44
XS1468662801 ADIE GL 3. 5 08-24	(UST) 150824	15,000,000.	M EUR	100.0492	% 30/06/23	98.264	4	2,242,900.88	2,233,008.72	30,128.04	-9,892.16	0.78
XS1647815775 ADRI BI 4. 875 07-24	(EUR) 010724	5,800,000.	M EUR	104.3262	% 30/06/23	99.2005	4	6,050,918.48	5,886,364.42	132,735.42	-164,554.06	2.07
FR0013477254 AIR FR 1. 875 01-25	(366) 160125	6,000,000.	M EUR	91.8762	% 30/06/23	94.0365	4	5,512,573.83	5,694,279.04	52,089.04	181,705.21	2.00
XS2054539627 ALTI FR 2. 5 01-25	(EUR) 150125	4,000,000.	M EUR	101.0396	% 30/06/23	92.8755	4	4,041,584.12	3,736,964.44	21,944.44	-304,619.68	1.31
XS1586831999 ARAM IN 3. 125 04-25	(EUR) 010425	6,000,000.	M EUR	103.4283	% 30/06/23	96.876	4	6,205,698.80	5,860,997.50	48,437.50	-344,701.30	2.06
XS0193945655 AUTOSTRA. 5. 875%06/24	(366) 090624	2,500,000.	M EUR	106.5351	% 30/06/23	101.6275	4	2,663,377.01	2,550,719.95	10,032.45	-112,657.06	0.90
XS1576621632 AVIS BU 4. 5 05-25	(EUR) 150525	6,400,000.	M EUR	100.7158	% 30/06/23	98.5915	4	6,445,808.94	6,349,056.00	39,200.00	-96,752.94	2.23
XS1492656787 AXAL CO 3. 75 01-25	(EUR) 150125	5,000,000.	M EUR	102.9917	% 30/06/23	98.563	4	5,149,586.05	5,016,170.83	88,020.83	-133,415.22	1.76
XS2080317832 BALL 0. 875 03-24	(UST) 150324	1,800,000.	M EUR	97.8505	% 30/06/23	97.6985	4	1,761,309.27	1,758,701.40	128.40	-2,607.87	0.62
XS2121417989 BANC BP 1. 625 02-25	(366) 180225	2,800,000.	M EUR	94.7968	% 30/06/23	94.296	4	2,654,310.57	2,657,241.42	16,953.42	2,930.85	0.93
XS2112340679 BANI EN 3. 5 03-25	(EUR) 010325	6,100,000.	M EUR	99.2904	% 30/06/23	97.953	4	6,056,716.62	6,048,078.83	72,945.83	-8,637.79	2.12
XS2093880735 BERR PL 1. 0 01-25	(UST) 150125	5,100,000.	M EUR	95.1004	% 30/06/23	95.273	4	4,850,120.99	4,882,873.28	23,950.28	32,752.29	1.71
FR0013469285 BERT CO 4. 5 12-24	(999) 201224	4,100,000.	M EUR	100.1793	% 30/06/23	97.241	E	4,107,350.00	4,087,843.50	100,962.50	-19,506.50	1.44
XS1811024543 CE ENER 1. 659 04-24	(366) 260424	6,000,000.	M EUR	89.3764	% 30/06/23	95.389	4	5,362,586.14	5,742,105.74	18,765.74	379,519.60	2.02
XS1227287221 CROW EUR 3. 38 05-25	(360) 150525	5,100,000.	M EUR	101.2249	% 30/06/23	98.164	4	5,162,471.89	5,029,792.13	23,428.13	-132,679.76	1.77
XS2363244513 DEUT LU 2. 0 07-24	(366) 140724	5,500,000.	M EUR	99.283	% 30/06/23	97.67	4	5,460,565.00	5,478,836.30	106,986.30	18,271.30	1.92
XS2296201424 DEUT LU 2. 875 02-25	(366) 110225	300,000.	M EUR	98.1904	% 30/06/23	97.089	4	294,571.23	294,646.11	3,379.11	74.88	0.10
XS1699848914 DUFUR ON 2. 5 10-24	(EUR) 151024	5,600,000.	M EUR	99.3209	% 30/06/23	97.908	4	5,561,973.15	5,513,570.22	30,722.22	-48,402.93	1.94
XS1992087996 EG GLOB 4. 375 02-25	(EUR) 070225	3,500,000.	M EUR	99.143	% 30/06/23	95.121	4	3,470,006.26	3,350,077.01	20,842.01	-119,929.25	1.18
FR0013413556 ELIS EX 1. 75 04-24	(366) 110424	2,000,000.	M EUR	98.476	% 30/06/23	97.9905	4	1,969,520.22	1,967,842.79	8,032.79	-1,677.43	0.69
FR0013461274 ERAMET 5. 875 05-25	(366) 210525	5,600,000.	M EUR	101.5828	% 30/06/23	102.041	4	5,688,634.77	5,753,847.91	39,551.91	65,213.14	2.02
FI4000507132 FINNAIR 4. 25 05-25	(EUR) 190525	5,500,000.	M EUR	100.4948	% 30/06/23	93.6405	4	5,527,215.18	5,179,446.25	29,218.75	-347,768.93	1.82
XS1987729412 FNAC DA 1. 875 05-24	(EUR) 300524	2,855,000.	M EUR	98.2463	% 30/06/23	97.58	4	2,804,931.88	2,790,964.73	5,055.73	-13,967.15	0.98
XS1767930586 FORD MO 1. 355 02-25	(366) 070225	5,000,000.	M EUR	97.5297	% 30/06/23	94.6565	4	4,876,486.63	4,760,110.62	27,285.62	-116,376.01	1.67
XS1785467751 FORVIA 2. 625 06-25	(EUR) 150625	5,924,000.	M EUR	99.3068	% 30/06/23	95.5995	4	5,882,935.18	5,671,521.59	8,207.21	-211,413.59	1.99
XS1598757760 GRIF 3. 2 05-25	(EUR) 010525	4,700,000.	M EUR	94.9334	% 30/06/23	97.5925	4	4,461,868.12	4,613,167.50	26,320.00	151,299.38	1.62
XS2060691719 HELL PE 2. 0 10-24	(UST) 041024	5,500,000.	M EUR	101.4402	% 30/06/23	96.951	4	5,579,208.83	5,359,654.73	27,349.73	-219,554.10	1.88
XS1764706310 HLD EUR 4. 0 12-23	(999) 191223	1,500,000.	M EUR	103.9074	% 30/06/23	99.421	E	1,558,611.12	1,524,148.33	32,833.33	-34,462.79	0.54
FR0013331196 I LIAD 1. 875 04-25	(366) 250425	5,900,000.	M EUR	99.0726	% 30/06/23	94.8485	4	5,845,282.29	5,617,219.29	21,157.79	-228,063.00	1.97
XS2322423455 INTL CO 2. 75 03-25	(366) 250325	6,100,000.	M EUR	99.8573	% 30/06/23	96.4515	4	6,091,298.19	5,929,833.17	46,291.67	-161,465.02	2.08
XS1844997970 INTL GA 3. 5 07-24	(EUR) 150724	6,990,000.	M EUR	102.6014	% 30/06/23	99.217	4	2,678,099.14	2,632,647.73	42,887.01	-45,451.41	0.92
XS1634532748 INTR JU 3. 125 07-24	(EUR) 150724	5,100,000.	M EUR	100.1779	% 30/06/23	93.1495	4	2,662,395.62	2,514,591.55	38,988.34	-147,804.07	0.88
XS1551347393 JAGU LA 2. 2 01-24	(EUR) 150124	1,700,000.	M EUR	90.1261	% 30/06/23	98.3965	4	1,532,144.23	1,690,297.72	17,557.22	158,153.49	0.59
XS2010037849 JAGU LA 5. 875 11-24	(EUR) 151124	4,500,000.	M EUR	104.6803	% 30/06/23	100.4055	4	4,710,612.92	4,554,231.88	35,984.38	-156,381.04	1.60
XS1605600532 LA FINA 4. 0 05-24	(EUR) 150524	900,000.	M EUR	92.8587	% 30/06/23	74.6385	4	835,728.50	676,646.50	4,900.00	-159,082.00	0.24
XS1990952779 LHMC FI 4. 75 05-25	(EUR) 220525	6,200,000.	M EUR	101.6021	% 30/06/23	98.6265	4	6,299,331.72	6,126,295.78	11,452.78	-173,035.94	2.15
XS1395004408 LKQ ITAL 3. 88 04-24	(360) 010424	5,300,000.	M EUR	100.1024	% 30/06/23	99.7345	4	5,305,429.38	5,338,983.71	53,055.21	33,554.33	1.88
XS2031870921 LOXA SA 3. 25 01-25	(USA) 140125	3,400,000.	M EUR	100.4914	% 30/06/23	98.148	4	3,416,707.02	3,370,488.94	33,456.94	-46,218.08	1.18
XS1590067432 LOXAM 6. 0 04-25	(EUR) 150425	3,650,000.	M EUR	105.9879	% 30/06/23	98.4985	4	1,930,775.22	1,818,326.73	23,985.64	-112,448.49	0.64
XS2312156115 LSF9 BA 7. 75 12-24	(EUR) 311224	3,000,000.	M EUR	100.9565	% 30/06/23	89.8625	E	3,028,694.45	2,822,561.29	71,828.31	-206,133.16	0.99
XS2166217278 NETF 3. 0 06-25	(EUR) 150625	3,000,000.	M EUR	98.4394	% 30/06/23	98.0885	4	2,953,183.33	2,947,405.00	4,750.00	-5,778.33	1.04

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

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 VAL/LIGNE	DOSSIER	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	
FR0013248713 NEXANS 2.75 04-24	(366)	050424	2,000,000.	M EUR	99.576	% 30/06/23	98.959	4	1,991,519.13	1,992,704.59	13,524.59	1,185.46	0.70
XS1713466222 NOVA 5.0 06-25	(EUR)	150625	4,000,000.	M EUR	92.7791	% 30/06/23	93.2975	4	3,711,165.13	3,742,455.56	10,555.56	31,290.43	1.31
PTNOB10M0014 NOVO BA 3.5 07-24	(366)	230724	5,000,000.	M EUR	99.9017	% 30/06/23	99.8165	4	4,995,085.90	5,156,715.41	165,890.41	161,629.51	1.81
XS2077666316 01 EURO 2.875 02-25	(EUR)	150225	5,800,000.	M EUR	102.5819	% 30/06/23	97.6375	4	5,949,751.06	5,727,359.03	64,384.03	-222,392.03	2.01
XS1794209459 PAPREC 4.0 03-25	(EUR)	310325	6,000,000.	M EUR	95.2646	% 30/06/23	98.3165	4	5,715,877.76	5,980,990.00	82,000.00	265,112.24	2.10
FR0013264066 PLAS OM 1.25 06-24	(366)	260624	4,100,000.	M EUR	98.0936	% 30/06/23	97.022	4	4,021,839.46	3,979,022.22	1,120.22	-42,817.24	1.40
XS2078976805 PPF ARE 2.125 01-25	(366)	310125	4,800,000.	M EUR	97.5968	% 30/06/23	96.236	4	4,684,644.81	4,662,363.62	43,035.62	-22,281.19	1.64
XS2176872849 PPF ARE 3.5 05-24	(366)	200524	1,500,000.	M EUR	102.2158	% 30/06/23	100.002	4	1,533,236.94	1,506,484.92	6,454.92	-26,752.02	0.53
XS2115189875 QPAR HO 1.5 03-25	(EUR)	010325	5,500,000.	M EUR	96.5886	% 30/06/23	96.104	4	5,312,374.99	5,313,907.50	28,187.50	1,532.51	1.87
FR0013478849 QUAD 2.25 02-25	(366)	030225	5,700,000.	M EUR	97.4111	% 30/06/23	95.0395	4	5,552,430.83	5,470,308.35	53,056.85	-82,122.48	1.92
XS2107451069 RCS RDS 2.5 02-25	(EUR)	050225	6,000,000.	M EUR	99.8417	% 30/06/23	95.593	4	5,990,500.00	5,797,663.33	62,083.33	-192,836.67	2.04
FR0013428414 RENA 1.25 06-25	(366)	240625	5,900,000.	M EUR	90.0179	% 30/06/23	93.86	4	5,311,056.53	5,539,755.03	2,015.03	228,698.50	1.95
XS2241090088 REPS IN 0.125 10-24	(366)	051024	2,500,000.	M EUR	95.4044	% 30/06/23	95.3105	4	2,385,110.89	2,385,091.27	2,328.77	-19.62	0.84
XS1819575066 ROLL RO 0.875 05-24	(366)	090524	370,000.	M EUR	97.1502	% 30/06/23	96.988	4	359,455.76	359,350.96	495.36	-104.80	0.13
XS2325693369 SCYRSM 3 1/4 04/02/2	(EXA)	020424	3,000,000.	M EUR	100.6617	% 30/06/23	98.7625	E	3,019,851.97	2,988,448.77	25,573.77	-31,403.20	1.05
XS1725581190 SILG HO 3.25 03-25	(EUR)	150325	3,500,000.	M EUR	97.8218	% 30/06/23	98.196	4	3,423,762.50	3,471,300.97	34,440.97	47,538.47	1.22
DE000A3H2UX0 SIXT SE 1.75 12-24	(366)	091224	4,250,000.	M EUR	97.669	% 30/06/23	96.701	4	4,150,934.33	4,151,972.29	42,179.79	1,037.96	1.46
XS1635870923 SM MTH 1.8 07-24	(360)	060724	1,000,000.	M EUR	98.275	% 30/06/23	96.629	4	982,750.00	984,190.00	17,900.00	1,440.00	0.35
XS2361253862 SOFT GR 2.125 07-24	(UST)	060724	5,700,000.	M EUR	100.058	% 30/06/23	96.8495	4	5,703,306.85	5,580,314.80	59,893.30	-122,992.05	1.96
XS1811213864 SOFT GR 4.5 04-25	(EUR)	200425	300,000.	M EUR	97.475	% 30/06/23	98.4095	4	292,425.00	298,003.50	2,775.00	5,578.50	0.10
XS1524573752 SUED IN 1.25 11-23	(366)	291123	334,000.	M EUR	98.2945	% 30/06/23	98.8035	4	328,303.70	332,485.81	2,482.12	4,182.11	0.12
FR0010780528 SUEZ SA 5.5 07-24	(366)	220724	1,000,000.	M EUR	106.6139	% 30/06/23	101.4345	4	1,066,138.77	1,066,632.67	52,287.67	493.90	0.37
XS1814546013 TELE CO 3.875 05-25	(EUR)	020525	4,450,000.	M EUR	99.0788	% 30/06/23	67.3165	4	4,409,007.32	3,025,281.82	29,697.57	-1,383,725.50	1.06
XS1935256369 TELE IT 4.0 04-24	(366)	110424	5,000,000.	M EUR	101.6227	% 30/06/23	98.8235	4	5,081,136.73	4,987,076.64	45,901.64	-94,060.09	1.75
XS1183235644 TEOL VOI 2.13 02-25	(366)	040225	3,800,000.	M EUR	97.5282	% 30/06/23	96.332	4	3,706,073.11	3,693,800.93	33,184.93	-12,272.18	1.30
XS1813724603 TEVA PH 4.25 03-25	(UST)	010325	2,500,000.	M EUR	106.1	% 30/06/23	99.1515	4	2,652,500.00	2,517,000.82	38,213.32	-135,499.18	0.88
XS2198213956 TEVA PH 6.0 01-25	(EUR)	310125	3,500,000.	M EUR	110.7685	% 30/06/23	101.634	4	3,876,898.15	3,647,023.33	89,833.33	-229,874.82	1.28
XS1724626699 VOLV CA 2.0 01-25	(366)	240125	5,000,000.	M EUR	95.8622	% 30/06/23	95.752	4	4,793,111.65	4,831,709.59	44,109.59	38,597.94	1.70
XS1971935223 VOLV CA 2.125 04-24	(366)	020424	950,000.	M EUR	98.667	% 30/06/23	98.1545	4	937,336.03	937,597.36	5,129.61	261.33	0.33
XS1707063589 WEBUI LD 1.75 10-24	(366)	261024	5,300,000.	M EUR	85.2452	% 30/06/23	95.8125	4	4,517,998.05	5,141,844.01	63,781.51	623,845.96	1.81
XS2288097483 WIZZ AI 1.35 01-24	(366)	190124	5,500,000.	M EUR	96.4949	% 30/06/23	97.9425	4	5,307,217.68	5,420,605.99	33,768.49	113,388.31	1.90

SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO

CUMUL (EUR)

287,166,450.55 282,322,820.91 2,712,174.06 -4,843,629.64 99.15

Obligations à taux variable, révisable négo. sur u

DEVISE VALEUR : EUR EURO

XS1729872736 FORD MOTO FLR 12-24	(999)	021224	2,000,000.	M EUR	97.8004	% 30/06/23	98.719	4	1,956,008.22	1,982,032.33	7,652.33	26,024.11	0.70
----------------------------------	-------	--------	------------	-------	---------	------------	--------	---	--------------	--------------	----------	-----------	------

Obligations & valeurs assimilées négociés sur un marché réglementé

CUMUL (EUR)

289,122,458.77 284,304,853.24 2,719,826.39 -4,817,605.53 99.85

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

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 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	
VIII - TRESORERIE													
Dettes et créances													
Règlements différés													
DEVISE VALEUR : EUR EURO													
VRDEUR	Vte rgl't différé	720,523.54	EUR	1.	30/06/23	1.		720,523.54	720,523.54	0.00	0.00	0.25	
Coupons et dividendes en espèces													
DEVISE VALEUR : EUR EURO													
XS2080317832	BALL 0.875 03-24	1,800.	P EUR	4.375	30/06/23			7,875.00	7,875.00	0.00	0.00	0.00	
Frais de gestion													
DEVISE VALEUR : EUR EURO													
FGPVFC1EUR	Frais de Gest. Fixe	-125,005.51	EUR	1.	30/06/23	1.		-125,005.51	-125,005.51	0.00	0.00	-0.04	
FGPVFC2EUR	Frais de Gest. Fixe	-814.72	EUR	1.	30/06/23	1.		-814.72	-814.72	0.00	0.00	0.00	
FGPVFC4EUR	Frais de Gest. Fixe	-46,735.58	EUR	1.	30/06/23	1.		-46,735.58	-46,735.58	0.00	0.00	-0.02	
FGPVFD1EUR	Frais de Gest. Fixe	-6,249.81	EUR	1.	30/06/23	1.		-6,249.81	-6,249.81	0.00	0.00	0.00	
FGPVFD3EUR	Frais de Gest. Fixe	-35,322.8	EUR	1.	30/06/23	1.		-35,322.80	-35,322.80	0.00	0.00	-0.01	
FGPVFD4EUR	Frais de Gest. Fixe	-8,259.69	EUR	1.	30/06/23	1.		-8,259.69	-8,259.69	0.00	0.00	0.00	
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO													
								CUMUL (EUR)	-222,388.11	-222,388.11	0.00	0.00	-0.08
Dettes et créances													
								CUMUL (EUR)	506,010.43	506,010.43	0.00	0.00	0.18
Disponibilités													
Avoirs en france													
DEVISE VALEUR : EUR EURO													
BORCEUR	ROTHSCHILD MM	-77,907.91	EUR	1.	30/06/23	1.		-77,907.91	-77,907.91	0.00	0.00	-0.03	
VIII - TRESORERIE													
								CUMUL (EUR)	428,102.52	428,102.52	0.00	0.00	0.15
PORTEFEUILLE : R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD (640048)													
								(EUR)	289,550,561.29	284,732,955.76	2,719,826.39	-4,817,605.53	100.00

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

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)

Portefeuille titres : 284,304,853.24 Coupons et dividendes a recevoir : 7,875.

Frais de gestion du jour

Frais de Gest. Fixe :	3,638.12	EUR
Frais de Gest. Fixe :	23.52	EUR
Frais de Gest. Fixe :	1,466.2	EUR
Frais de Gest. Fixe :	181.13	EUR
Frais de Gest. Fixe :	1,009.2	EUR
Frais de Gest. Fixe :	243.49	EUR

Frais de gestion charge Entreprise

FRAIS MAXIMUM :	3,638.12	EUR
FRAIS MAXIMUM :	23.52	EUR
FRAIS MAXIMUM :	1,466.2	EUR
FRAIS MAXIMUM :	181.13	EUR
FRAIS MAXIMUM :	1,009.2	EUR
FRAIS MAXIMUM :	243.49	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	132,787,914.54	1,223,771.054	108.51	46.636151476409			111.22	108.51
C2	FR0013269438 R-CO TA 2024 HY FEUR EUR	715,352.42	6,629.828	107.90	0.251238727823			110.60	107.90
C4	FR0013269453 R-CO TA 2024 HYICEUR EUR	107,031,348.52	95,958.838	1,115.39	37.589729620493			1,143.27	1,115.39
D1	FR0013269420 R-CO TA 2024 HY DEUR EUR	6,611,119.90	71,000.007	93.11	2.32187688141			95.44	93.11
D3	FR0013269503 R-CO TA 2024 HYNMKDE EUR	27,488,319.41	297,377.366	92.44	9.654202149107			94.75	92.44
D4	FR0013269511 R-CO TA 2024 HY NMKI EUR	10,098,900.97	10,900.548	926.46	3.546801144758			949.62	926.46
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 : 284,732,955.76

Precedente VL en date du 29/06/23 :

C1	R-CO TA 2024 HY CEUR	Prec. VL :	108.49	(EUR)	Variation :	+0.018%
C2	R-CO TA 2024 HY FEUR	Prec. VL :	107.88	(EUR)	Variation :	+0.019%
C4	R-CO TA 2024 HYICEUR	Prec. VL :	1,115.15	(EUR)	Variation :	+0.022%
D1	R-CO TA 2024 HY DEUR	Prec. VL :	93.1	(EUR)	Variation :	+0.011%

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 30/06/23

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)

D3	R-CO TA 2024 HYNMKDE	Prec. VL :	92.42	(EUR)	Variation :	+0.022%
D4	R-CO TA 2024 HY NMKI	Prec. VL :	926.27	(EUR)	Variation :	+0.021%

VL theorique

Part	Devise	Actif theorique	Valeur liquidative theorique
C1 FR0013269412 R-CO TA 2024 HY CEUR	EUR	132,787,914.54	108.51
C2 FR0013269438 R-CO TA 2024 HY FEUR	EUR	715,352.42	107.90
C4 FR0013269453 R-CO TA 2024 HYICEUR	EUR	107,031,348.52	1,115.39
D1 FR0013269420 R-CO TA 2024 HY DEUR	EUR	6,611,119.90	93.11
D3 FR0013269503 R-CO TA 2024 HYNMKDE	EUR	27,488,319.41	92.44
D4 FR0013269511 R-CO TA 2024 HY NMKI	EUR	10,098,900.97	926.46

Actif theorique total en EUR : 284,732,955.76 (Sens collecte : EQU)

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 01/05/23 :

Poids DD :	95.64	Statut DD :	0
Poids DI :	100.	Statut DI :	M

Type reporting : TISF TIS France

Poids officiels et statuts en date du 30/06/23 :

Poids DD :	99.8	Statut DD :	I
Poids DI :	99.8	Statut DI :	M

Poids non officiels en date du 30/06/23 :

Poids DD :	99.8
Poids DI :	99.8

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

R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD

DOCUMENT D'INFORMATION PÉRIODIQUE AU 30/06/2023

ETAT DU PATRIMOINE EN EUR

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier	284 304 853,24
b) Avoirs bancaires	0,00
c) Autres actifs détenus par l'OPC	728 398,54
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	285 033 251,78
e) Passif	-300 296,02
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	284 732 955,76

* 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	132 787 914,54	1 223 771,054	108,51
R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD D EUR en EUR	D	6 611 119,90	71 000,007	93,11
R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD F EUR en EUR	C	715 352,42	6 629,828	107,90
R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD IC EUR en EUR	C	107 031 348,52	95 958,838	1 115,39
R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD NAGELMACKERS D EUR en EUR	D	27 488 319,41	297 377,366	92,44
R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD NAGELMACKERS ID EUR en EUR	D	10 098 900,97	10 900,548	926,46

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.	81,51	81,43
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.	18,34	18,32
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	0,00	0,00

* 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	284 304 853,24	99,85	99,74
TOTAL		284 304 853,24	99,85	99,74

* 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	29,55	29,52
PAYS-BAS	17,18	17,16
ROYAUME-UNI	8,53	8,52
ITALIE	7,26	7,25
ETATS-UNIS	6,95	6,95
LUXEMBOURG	5,74	5,73
ALLEMAGNE	5,14	5,14
ESPAGNE	4,75	4,75
FINLANDE	3,12	3,11
SUEDE	2,91	2,91
JAPON	2,06	2,06
ROUMANIE	2,04	2,03
REPUBLIQUE TCHEQUE	2,02	2,01
PORTUGAL	1,81	1,81
JERSEY	0,78	0,78
TOTAL	99,85	99,74

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

RÉPARTITION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE

Nature d'actifs	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Organismes de placement collectif		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	0,00	0,00
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE	0,00	0,00
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés	0,00	0,00
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés	0,00	0,00
Autres organismes non européens	0,00	0,00
Autres actifs		
Autres	0,00	0,00
TOTAL	0,00	0,00

* 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.	62 680 517,72	64 224 027,72
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	18 495 540,73	10 584 111,40
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.	44 202 330,64	58 599 995,22

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Action	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
Dividendes versés				
24/02/2023	R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD D EUR	2,73	0,00	2,73
24/02/2023	R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD NAGELMACKERS ID EUR	28,29	0,00	28,29
24/02/2023	R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD NAGELMACKERS D EUR	2,39	0,00	2,39
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			

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2023 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
ACCENTRO REAL ESTATE AG 3.625% 13-02-26	EUR	3 000 000	1 696 678,73	0,60
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2.0% 14-07-24	EUR	5 500 000	5 478 836,30	1,92
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2.875% 11-02-25	EUR	300 000	294 646,11	0,10
SIXT SE 1.75% 09-12-24 EMTN	EUR	4 250 000	4 151 972,29	1,46
TELE COLUMBUS AG 3.875% 02-05-25	EUR	4 450 000	3 025 281,82	1,06
TOTAL ALLEMAGNE			14 647 415,25	5,14
ESPAGNE				
GRIFOLS 3.2% 01-05-25	EUR	4 700 000	4 613 167,50	1,62
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROU 2.75% 25-03-25	EUR	6 100 000	5 929 833,17	2,08
SCYRSM 3 1/4 04/02/24	EUR	3 000 000	2 988 448,77	1,05
TOTAL ESPAGNE			13 531 449,44	4,75
ETATS-UNIS				
BALL 0.875% 15-03-24	EUR	1 800 000	1 758 701,40	0,62
BERRY PLASTICS 1.0% 15-01-25	EUR	5 100 000	4 882 873,28	1,71
FORD MOTOR CREDIT 1.355% 07-02-25	EUR	5 000 000	4 760 110,62	1,67
FORD MOTOR CREDIT E3R+0.7% 01-12-24	EUR	2 000 000	1 982 032,33	0,69
NETFLIX 3.0% 15-06-25	EUR	3 000 000	2 947 405,00	1,04
SILGAN HOLDINGS INC 3.25% 15-03-25	EUR	3 500 000	3 471 300,97	1,22
TOTAL ETATS-UNIS			19 802 423,60	6,95
FINLANDE				
FINNAIR 4.25% 19-05-25	EUR	5 500 000	5 179 446,25	1,82
TEOL VOI 2.125% 04-02-25 EMTN	EUR	3 800 000	3 693 800,93	1,30
TOTAL FINLANDE			8 873 247,18	3,12
FRANCE				
ACCOR 2.5% 25-01-24	EUR	4 100 000	4 105 120,51	1,44
AIR FR KLM 1.875% 16-01-25	EUR	6 000 000	5 694 279,04	2,00
ALTICE FRANCE 2.5% 15-01-25	EUR	4 000 000	3 736 964,44	1,31
BANIJAY ENTERTAINMENT SASU 3.5% 01-03-25	EUR	6 100 000	6 048 078,83	2,12
BERTRAND CORP 4.5% 20-12-24	EUR	4 100 000	4 087 843,50	1,44
CROW EURO HOL 3.375% 15-05-25	EUR	5 100 000	5 029 792,13	1,77
ELIS EX HOLDELIS 1.75% 11-04-24	EUR	2 000 000	1 967 842,79	0,69
ERAMET 5.875% 21-05-25	EUR	5 600 000	5 753 847,91	2,02
FNAC DARTY 1.875% 30-05-24	EUR	2 855 000	2 790 964,73	0,98
FORVIA 2.625% 15-06-25	EUR	5 924 000	5 671 521,59	1,99
ILIAD 1.875% 25-04-25	EUR	5 900 000	5 617 219,29	1,97
LA FINANCIERE ATALIAN 4.0% 15-05-24	EUR	900 000	676 646,50	0,24
LOXAM 6.0% 15-04-25	EUR	3 650 000	1 818 326,73	0,64
LOXAM SAS 3.25% 14-01-25	EUR	3 400 000	3 370 488,94	1,18
NEXANS 2.75% 05-04-24	EUR	2 000 000	1 992 704,59	0,70
NOVAFIVES 5.0% 15-06-25	EUR	4 000 000	3 742 455,56	1,32
PAPREC 4.0% 31-03-25	EUR	6 000 000	5 980 990,00	2,10
PLASTIC OMNIUM SYSTEMES URBAINS 1.25% 26-06-24	EUR	4 100 000	3 979 022,22	1,40
QUADIENT 2.25% 03-02-25	EUR	5 700 000	5 470 308,35	1,92
RENAULT 1.25% 24-06-25 EMTN	EUR	5 900 000	5 539 755,03	1,95

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SUEZ 5.5% 22-07-24 EMTN	EUR	1 000 000	1 066 632,67	0,37
TOTAL FRANCE			84 140 805,35	29,55
ITALIE				
AUTOSTRAD 5 7/8 2024	EUR	2 500 000	2 550 719,95	0,89
BANCO BPM 1.625% 18-02-25 EMTN	EUR	2 800 000	2 657 241,42	0,93
LKQ ITAL BOND 3.875% 01-04-24	EUR	5 300 000	5 338 983,71	1,88
TELECOM ITALIA SPA EX OLIVETTI 4.0% 11-04-24	EUR	5 000 000	4 987 076,64	1,76
WEBUILD SPA 1.75% 26-10-24	EUR	5 300 000	5 141 844,01	1,81
TOTAL ITALIE			20 675 865,73	7,27
JAPON				
SOFTBANK GROUP 2.125% 06-07-24	EUR	5 700 000	5 580 314,80	1,97
SOFTBANK GROUP 4.5% 20-04-25	EUR	300 000	298 003,50	0,10
TOTAL JAPON			5 878 318,30	2,07
JERSEY				
ADIANT GLOBAL HOLDINGS 3.5% 15-08-24	EUR	15 000 000	2 233 008,72	0,78
TOTAL JERSEY			2 233 008,72	0,78
LUXEMBOURG				
ARAMARK INTERNATIONAL FINANCE SARL 3.125% 01-04-25	EUR	6 000 000	5 860 997,50	2,06
HLD EUROPE SCA 4.0% 19-12-23	EUR	1 500 000	1 524 148,33	0,54
LHMC FINCO SARL 4.75% 22-05-25	EUR	6 200 000	6 126 295,78	2,15
LSF9 BALTA ISSUER 7.75% 31-12-24	EUR	3 000 000	2 822 561,29	0,99
TOTAL LUXEMBOURG			16 334 002,90	5,74
PAYS-BAS				
ADRIA BIDCO BV 4.875% 01-07-24	EUR	5 800 000	5 886 364,42	2,07
AXAL COAT 3.75% 15-01-25	EUR	5 000 000	5 016 170,83	1,76
DUFY ONE BV 2.5% 15-10-24	EUR	5 600 000	5 513 570,22	1,94
OI EUROPEAN GROUP BV 2.875% 15-02-25	EUR	5 800 000	5 727 359,03	2,01
PPF ARENA 2.125% 31-01-25 EMTN	EUR	4 800 000	4 662 363,62	1,64
PPF ARENA 3.5% 20-05-24 EMTN	EUR	1 500 000	1 506 484,92	0,53
QPARK HOLDING I BV 1.5% 01-03-25	EUR	5 500 000	5 313 907,50	1,87
REPSOL INTL FINANCE BV 0.125% 05-10-24	EUR	2 500 000	2 385 091,27	0,83
SM MTH AUTO GRP 1.8% 06-07-24	EUR	1 000 000	984 190,00	0,34
SUEDZUCKER INTL FINANCE BV 1.25% 29-11-23	EUR	334 000	332 485,81	0,12
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 4.25% 01-03-25	EUR	2 500 000	2 517 000,82	0,89
TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE II BV 6.0% 31-01-25	EUR	3 500 000	3 647 023,33	1,28
WIZZ AIR FINANCE CO BV 1.35% 19-01-24	EUR	5 500 000	5 420 605,99	1,90
TOTAL PAYS-BAS			48 912 617,76	17,18
PORTUGAL				
NOVO BAN 3.5% 23-07-24	EUR	5 000 000	5 156 715,41	1,81
TOTAL PORTUGAL			5 156 715,41	1,81
REPUBLIQUE TCHEQUE				
CE ENERGY AS 1.659% 26-04-24	EUR	6 000 000	5 742 105,74	2,01
TOTAL REPUBLIQUE TCHEQUE			5 742 105,74	2,01
ROUMANIE				
RCS RDS 2.5% 05-02-25	EUR	6 000 000	5 797 663,33	2,04
TOTAL ROUMANIE			5 797 663,33	2,04
ROYAUME-UNI				

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
AVIS BUDGET FINANCE PLC 4.5% 15-05-25	EUR	6 400 000	6 349 056,00	2,23
EG GLOBAL FINANCE PLC 4.375% 07-02-25	EUR	3 500 000	3 350 077,01	1,18
HELLENIC PETROLEUM FINANCE 2.0% 04-10-24	EUR	5 500 000	5 359 654,73	1,88
INTL GAME TECHNOLOGY 3.5% 15-07-24	EUR	6 990 000	2 632 647,73	0,92
JAGUAR LAND ROVER 5.875% 15-11-24	EUR	4 500 000	4 554 231,88	1,60
JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE 2.2% 15-01-24	EUR	1 700 000	1 690 297,72	0,59
ROLLS ROYCE 0.875% 09-05-24	EUR	370 000	359 350,96	0,13
TOTAL ROYAUME-UNI			24 295 316,03	8,53
SUEDE				
INTRUM JUSTITIA AB 3.125% 15-07-24	EUR	5 100 000	2 514 591,55	0,88
VOLVO CAR AB 2.0% 24-01-25	EUR	5 000 000	4 831 709,59	1,70
VOLVO CAR AB 2.125% 02-04-24	EUR	950 000	937 597,36	0,33
TOTAL SUEDE			8 283 898,50	2,91
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			284 304 853,24	99,85
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			284 304 853,24	99,85
Créances			728 398,54	0,26
Dettes			-222 388,11	-0,08
Comptes financiers			-77 907,91	-0,03
Actif net			284 732 955,76	100,00

Parts R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD C EUR	EUR	1 223 771,054	108,51
Parts R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD D EUR	EUR	71 000,007	93,11
Parts R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD F EUR	EUR	6 629,828	107,90
Parts R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD IC EUR	EUR	95 958,838	1 115,39
Parts R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD NAGELMACKERS D EUR	EUR	297 377,366	92,44
Parts R-CO TARGET 2024 HIGH YIELD NAGELMACKERS ID EUR	EUR	10 900,548	926,46