

COVÉA OBLIGATIONS CONVERTIBLES

FCP de droit français

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	284 536 953,52
b) Avoirs bancaires	31 154 350,85
c) Autres actifs détenus par l'OPC	40 712 906,55
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	356 404 210,92
e) Passif	-9 063 062,49
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	347 341 148,43

* Les montants sont signés

NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
COVEA OBLIGATIONS CONVERTIBLES AC en EUR	C	140 067 262,18	5 853,3133	23 929,56
COVEA OBLIGATIONS CONVERTIBLES IC en EUR	C	61 123 597,23	2 406,3476	25 400,98
COVEA OBLIGATIONS CONVERTIBLES ID en EUR	D	146 150 289,02	1 329 347,2671	109,94

ELEMENT 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.	74,59	72,69
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.		
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.	7,33	7,14
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	9,90	9,65

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

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

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Euro	EUR	217 424 093,42	62,60	61,00
Dollar Us	USD	45 247 092,20	13,03	12,70
Franc Suisse	CHF	16 678 651,64	4,80	4,68
Livre Sterling	GBP	5 187 116,26	1,49	1,46
TOTAL		284 536 953,52	81,92	79,84

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

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

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RESIDENCE DE L'EMETTEUR

Pays	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
FRANCE	38,28	37,30
ALLEMAGNE	12,16	11,85
ITALIE	9,62	9,38
PAYS-BAS	7,46	7,27
ESPAGNE	5,44	5,30
SUISSE	4,80	4,68
ROYAUME-UNI	1,92	1,87
LUXEMBOURG	1,63	1,59
ETATS-UNIS	0,61	0,59
TOTAL	81,92	79,84

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

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

REPARTITION 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	7,42	7,24
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE		
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés	2,48	2,41
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés		
Autres organismes non européens		
Autres actifs		
Autres		
TOTAL	9,90	9,65

* 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.	48 957 720,45	36 835 325,91
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.		
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.	2 061 996,66	
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	220 246,00	441 210,00

DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE

Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt (1) EUR	Montant brut unitaire (2) EUR
Dividendes versés			
COVEA OBLIGATIONS CONVERTIBLES ID			
Dividendes à verser			
COVEA OBLIGATIONS CONVERTIBLES ID			

(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.

INFORMATIONS DIVERSES

Etablissement dépositaire : CACEIS Bank - 1-3 place Valhubert - 75013 - Paris

Le relevé Périodicité Semestrielle détaillé de l'actif est disponible dans un délai de huit semaines à compter de la fin de la période. Il peut être transmis sur simple demande auprès de la société de gestion :

COVÉA FINANCE SASU - 8-12 rue Boissy d'Anglas - 75008 - Paris

TRANSPARENCE DES OPERATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA REUTILISATION DES INSTRUMENTS FINANCIERS - REGLEMENT SFTR - en devise de comptabilité de l'OPC (EUR)

Au cours de l'exercice, l'OPC n'a pas fait l'objet d'opérations relevant de la réglementation SFTR.

PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2021 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Actions et valeurs assimilées				
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
FRANCE				
L'OREAL	EUR	7 000	2 630 600,00	0,75
ORANGE	EUR	70 000	673 050,00	0,19
WORLDLINE SA	EUR	17 714	1 398 343,16	0,41
TOTAL FRANCE			4 701 993,16	1,35
ROYAUME-UNI				
UNILEVER PLC	EUR	30 179	1 489 786,34	0,43
TOTAL ROYAUME-UNI			1 489 786,34	0,43
TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			6 191 779,50	1,78
TOTAL Actions et valeurs assimilées			6 191 779,50	1,78
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
ADIDAS AG 0.05% 12-09-23 CV	EUR	5 000 000	6 277 456,85	1,81
BASF 0.925% 09-03-23 EMTN	USD	3 000 000	2 539 671,34	0,73
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 2.0% 17-11-25 CV	EUR	1 700 000	1 827 661,50	0,52
DEUTSCHE POST AG 0.05% 30-06-25	EUR	5 000 000	6 109 176,71	1,76
FRESENIUS SE ZCP 31-01-24	EUR	3 600 000	3 582 864,00	1,03
MTU AERO ENGI 0.125% 17-05-23	EUR	300 000	506 243,26	0,15
MTU AERO ENGINES GMBH 0.05% 18-03-27	EUR	5 100 000	5 013 760,05	1,45
RAG STIFTUNG ZCP 02-10-24 CV	EUR	5 300 000	5 411 088,00	1,56
RAG STIFTUNG ZCP 16-03-23	EUR	3 800 000	3 923 975,00	1,13
RAG STIFTUNG ZCP 17-06-26 CV	EUR	1 600 000	1 832 696,00	0,52
SYMRISE AG 0.2375% 20-06-24	EUR	4 000 000	5 214 592,33	1,50
TOTAL ALLEMAGNE			42 239 185,04	12,16
ESPAGNE				
CELLNEX TELECOM 0.5% 05-07-28 CV	EUR	5 800 000	7 962 320,64	2,29
CELLNEX TELECOM 1.5% 16-01-26 CV	EUR	4 100 000	7 601 268,86	2,19
INDR SIST 1.25% 07-10-23	EUR	3 300 000	3 329 921,62	0,96
TOTAL ESPAGNE			18 893 511,12	5,44
FRANCE				
AIR FRANCE KLM 0.125% 25-03-26	EUR	180 000	2 889 360,00	0,83
ARCHER OBLIGATIONS ZCP 31-03-23	EUR	3 400 000	6 083 671,00	1,76
CARREFOUR ZCP 27-03-24 CV	USD	3 000 000	2 625 277,68	0,75
CIE GEN DES ETS MICHELIN ZCP 10-01-22	USD	4 400 000	3 978 660,38	1,14
CIE GEN DES ETS MICHELIN ZCP 10-11-23	USD	5 400 000	4 657 454,56	1,35
EDENRED ZCP 06-09-24 CV	EUR	120 905	7 604 682,69	2,19
EDF ZCP 14-09-24 CV	EUR	332 982	5 072 481,30	1,46

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ELIS EX HOLDELIS ZCP 06-10-23	EUR	331 397	10 359 470,22	2,98
ENGIE 0.0% 02-06-24 CV	EUR	37 780	3 125 577,18	0,90
FRAN ZCP 01-04-28 CV	EUR	55 000	10 060 985,00	2,89
KERING ZCP 30-09-22 CV EMTN	EUR	6 200 000	7 153 126,00	2,06
MAISON DU MONDE SAS 0.125% 06-12-23	EUR	25 150	1 170 342,68	0,34
ORPEA 0.375% 17-05-27 CV	EUR	60 651	9 032 723,10	2,60
SAFRAN 0.875% 15-05-27 CV	EUR	33 262	4 698 822,95	1,35
SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.0000010% 15-06-26	EUR	32 569	6 388 621,05	1,84
SEB ZCP 17-11-21	EUR	7 000	1 283 187,50	0,37
SOITEC ZCP 01-10-25 CV	EUR	20 000	4 486 140,00	1,29
TOTALENERGIES SE 0.5% 02-12-22 CV	USD	8 400 000	7 191 928,64	2,07
UBISOFT ZCP 24-09-24 CV	EUR	68 000	7 749 042,00	2,23
VEOLIA ENVIRONNEMENT ZCP 01-01-25	EUR	182 209	5 876 149,15	1,69
VINCI 0.375% 16-02-22	USD	6 000 000	5 717 351,06	1,65
WORLDLINE ZCP 30-07-25 CV	EUR	31 818	3 921 886,68	1,13
WORLDLINE ZCP 30-07-26 CV	EUR	62 379	7 121 217,83	2,05
TOTAL FRANCE			128 248 158,65	36,92
ITALIE				
ENI ZCP 13-04-22 EMTN	EUR	10 000 000	10 015 750,00	2,88
PRYSMIAN 0.0000010% 02-02-26	EUR	4 000 000	4 042 920,00	1,17
PRYSMIAN ZCP 17-01-22	EUR	2 300 000	2 321 528,00	0,67
SNAM ZCP 20-03-22	EUR	4 500 000	4 771 800,00	1,37
TELECOM ITALIA SPA EX OLIVETTI 1.125% 26-03-22	EUR	12 200 000	12 278 945,27	3,54
TOTAL ITALIE			33 430 943,27	9,63
LUXEMBOURG				
LAGFIN SCA 2.0% 02-07-25 CV	EUR	4 600 000	5 650 042,00	1,63
TOTAL LUXEMBOURG			5 650 042,00	1,63
PAYS-BAS				
IBERDROLA INTERNATIONAL BV ZCP 11-11-22 CV	EUR	7 700 000	9 480 817,50	2,73
QIAGEN NV 1.0% 13-11-24 CV	USD	6 000 000	6 021 008,64	1,73
QIAGEN NV ZCP 17-12-27 CV	USD	3 000 000	2 448 872,43	0,71
STMICROELECTRONICS NV 0.0000010% 04-08-25	USD	1 600 000	1 624 624,71	0,46
STMICROELECTRONICS NV 0.0000010% 04-08-27	USD	4 200 000	4 260 769,94	1,23
STMICROELECTRONICS NV 0.25% 03-07-24	USD	1 400 000	2 077 856,18	0,60
TOTAL PAYS-BAS			25 913 949,40	7,46
ROYAUME-UNI				
BP CAP MK 1.0% 28-04-23	GBP	4 300 000	5 187 116,26	1,49
TOTAL ROYAUME-UNI			5 187 116,26	1,49
SUISSE				
SIKA AG 0.15% 05-06-25 CV	CHF	11 400 000	16 678 651,64	4,80
TOTAL SUISSE			16 678 651,64	4,80

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			276 241 557,38	79,53
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			276 241 557,38	79,53
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ETATS-UNIS				
UNIT STAT TREA BIL ZCP 22-07-21	USD	2 500 000	2 103 616,64	0,61
TOTAL ETATS-UNIS			2 103 616,64	0,61
TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			2 103 616,64	0,61
TOTAL Titres de créances			2 103 616,64	0,61
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
COVEA SECURITE G	EUR	87 500	19 271 175,00	5,55
MULTI UNIT FRANCE SICAV LYXOR-CAC 40 DR ETF UCITS Dist	EUR	100 000	6 515 000,00	1,87
TOTAL FRANCE			25 786 175,00	7,42
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			25 786 175,00	7,42
Fonds professionnels à vocation générale et équival. d'autres Etats membres UE et organismes de titrisation cotés				
LUXEMBOURG				
Xtrackers Stoxx Europe 600 UCITS ETF 1CC	EUR	84 000	8 606 640,00	2,48
TOTAL LUXEMBOURG			8 606 640,00	2,48
TOTAL Fonds professionnels à vocation générale et équival. d'autres Etats membres UE et organismes de titrisation cotés			8 606 640,00	2,48
TOTAL Organismes de placement collectif			34 392 815,00	9,90
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
EURO STOXX 50 0921	EUR	100	-59 500,00	-0,02
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			-59 500,00	-0,02
TOTAL Engagements à terme fermes			-59 500,00	-0,02
TOTAL Instrument financier à terme			-59 500,00	-0,02
Appel de marge				
APPEL MARGE CACEIS	EUR	59 500	59 500,00	0,02
TOTAL Appel de marge			59 500,00	0,02
Créances			6 260 591,55	1,80
Dettes			-9 003 562,49	-2,59
Comptes financiers			31 154 350,85	8,97
Actif net			347 341 148,43	100,00