

ALPHA CONVICTIONS OBLIGATAIRES

DOCUMENT D'INFORMATION PÉRIODIQUE
28/06/2024

ETAT DU PATRIMOINE EN EUR

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique (*)
elements_etat_patrimoine.a_l_214_20	29 287 672,89
b) Avoirs bancaires	107 875,27
c) Autres actifs détenus par l'OPC	8 465 972,80
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	37 861 520,96
e) Passif	-37 679,22
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	37 823 841,74

(*) Les montants sont signés

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

Part	Type de part	Actif net de la part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
ALPHA CONVICTIONS OBLIGATAIRES PART C	C	37 823 841,74	349 581,410	108,19

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. 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.	66,86	66,79
elements_portefeuille_titres.c_autre_marche	10,57	10,56
elements_portefeuille_titres.d_nouvellement_emis	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	22,38	22,36

(*) 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	29 287 672,89	77,43	77,35
TOTAL		29 287 672,89	77,43	77,35

(*) 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	29,65	29,62
PAYS-BAS	14,37	14,35
ITALIE	13,68	13,67
ETATS-UNIS	7,02	7,01
ROYAUME-UNI	3,55	3,55
BELGIQUE	3,52	3,52
ESPAGNE	3,17	3,17
LUXEMBOURG	2,47	2,46
TOTAL	77,43	77,35

(*) 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 (**)
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	22,38	22,36
Autres OPC et fonds d'investissements	0,00	0,00
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	0,00	0,00
Autres	0,00	0,00
TOTAL	22,38	22,36

(*) 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.	0,00	0,00
mouvements_portefeuille_titres.c_autre_marche	0,00	0,00
mouvements_portefeuille_titres.d_nouvellement_emis	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	0,00	233 815,00

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES			29 287 672,89	77,43
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			29 287 672,89	77,43
Assurance			3 568 075,31	9,43
ASSI 5.0% 08-06-48 EMTN	EUR	1 100 000	1 131 627,94	2,99
CAISSE NATLE DE REASSU MUT AGRICOLE 0.75% 07-07-28	EUR	1 500 000	1 331 373,81	3,52
CNP ASSURANCES 4.5% 10-06-47	EUR	1 100 000	1 105 073,56	2,92
Banques commerciales			11 212 159,62	29,63
BNP PAR 2.5% 31-03-32 EMTN	EUR	1 400 000	1 339 503,03	3,54
CA 2.0% 25-03-29 EMTN	EUR	1 500 000	1 387 649,49	3,67
CAIXABANK 0.75% 26-05-28 EMTN	EUR	1 300 000	1 199 900,36	3,17
ING GROEP NV 4.125% 24-08-33	EUR	1 300 000	1 335 765,13	3,53
INTE 5.0% 08-03-28 EMTN	EUR	1 100 000	1 149 654,45	3,04
JP MORGAN CHASE AND CO 1.638% 18-05-28	EUR	1 000 000	949 724,45	2,51
KBC GROUPE 4.875% 25-04-33	EUR	1 300 000	1 332 242,85	3,52
SG 5.25% 06-09-32 EMTN	EUR	1 200 000	1 279 965,34	3,38
UNICREDIT 4.45% 16-02-29 EMTN	EUR	1 200 000	1 237 754,52	3,27
Distribution de produits alimentaires de première nécessité			1 186 430,40	3,14
NN GROUP NV FIX 13-01-48 EMTN	EUR	1 150 000	1 186 430,40	3,14
Divertissement			376 348,20	1,00
VIVENDI 1.125% 11-12-28 EMTN	EUR	400 000	376 348,20	1,00
Logiciels			969 583,72	2,56
FIAT CHRYSLER AUTOMOBILES NV 4.5% 07-07-28	EUR	900 000	969 583,72	2,56
Marchés de capitaux			2 182 392,47	5,77
GOLD SACH GR 1.25% 07-02-29	EUR	1 000 000	905 391,34	2,39
VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV 4.625% PERP	EUR	1 300 000	1 277 001,13	3,38
Métaux et minerais			477 004,54	1,26
ARCELLOR MITTAL 4.875% 26-09-26	EUR	450 000	477 004,54	1,26
Outils et services appliqués aux sciences biologiques			456 029,03	1,21
EUROFINS SCIENTIFIC SE 4.0% 06-07-29	EUR	450 000	456 029,03	1,21
Pétrole et gaz			3 973 543,69	10,51
BP CAP MK 3.625% PERP	EUR	1 400 000	1 344 394,72	3,55
ENI 2.0% PERP	EUR	1 300 000	1 209 915,61	3,20
TOTALENERGIES SE 1.625% PERP	EUR	1 550 000	1 419 233,36	3,76
Services aux collectivités			1 609 818,63	4,26
ENGIE 1.5% PERP	EUR	1 300 000	1 163 267,92	3,08
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.5% 15-07-28	EUR	500 000	446 550,71	1,18
Services de télécommunication diversifiés			1 267 272,31	3,35
ORANGE 1.75% PERP EMTN	EUR	1 400 000	1 267 272,31	3,35
Services financiers diversifiés			1 464 459,61	3,87
ENEL FINANCE INTL NV 3.875% 09-03-29	EUR	650 000	664 731,54	1,76

Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
PROLOGIS EURO FINANCE LLC 1.0% 08-02-29	EUR	900 000	799 728,07	2,11
Sociétés d'investissement immobilier cotées (SIIC)			544 555,36	1,44
UNIBAIL RODAMCO SE 1.5% 29-05-29	EUR	600 000	544 555,36	1,44
TITRES D'OPC			8 465 972,80	22,38
OPCVM			8 465 972,80	22,38
Gestion collective			8 465 972,80	22,38
CARMIGNAC CREDIT 2027 F EUR Acc	EUR	12 640	1 514 272,00	4,00
EDR SICAV MILLESIMA WORLD 2028 ACTION I EUR	EUR	12 730	1 454 275,20	3,84
IVO 2028 Part I	EUR	10 200	1 250 010,00	3,30
La Francaise Rendement Global 2028 IC EUR	EUR	1 410	1 500 465,60	3,97
Pluvalca Credit Opportunities 2028 I	EUR	1 200	1 363 932,00	3,61
TIKEHAU 2027 I Acc EUR	EUR	11 900	1 383 018,00	3,66
Total			37 753 645,69	99,81

(*) Le secteur d'activité représente l'activité principale de l'émetteur de l'instrument financier ; il est issu de sources fiables reconnues au plan international (GICS et NACE principalement).

Inventaire des opérations à terme de devises

Type d'opération	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)			
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)	
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)
Total	0,00	0,00		0,00		0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions exprimé dans la devise de comptabilisation.

Inventaire des instruments financiers à terme

Inventaire des instruments financiers à terme - actions

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - taux d'intérêts

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - de change

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - sur risque de crédit

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme - autres expositions

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

Inventaire des instruments financiers à terme ou des opérations à terme de devises utilisés en couverture d'une catégorie de part

L'OPC sous revue n'est pas concerné par cette rubrique.

Synthèse de l'inventaire

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	37 753 645,69
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	0,00
Total instruments financiers à terme - actions	0,00
Total instruments financiers à terme - taux	0,00
Total instruments financiers à terme - change	0,00
Total instruments financiers à terme - crédit	0,00
Total instruments financiers à terme - autres expositions	0,00
Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises	0,00
Autres actifs (+)	107 875,27
Autres passifs (-)	-37 679,22
Passifs de financement (-)	0,00
Total = actif net	37 823 841,74

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part ALPHA CONVICTIONS OBLIGATAIRES PART C	EUR	349 581,410	108,19