

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

Document d'information périodique au 30/09/2024

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

Sommaire

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR	3
NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART OU ACTION	4
ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR	5
MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR	6
DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE	7
RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR DEVISE	8
RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR SECTEUR ÉCONOMIQUE	9
RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR	10
VENTILATION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE	11
COMMISSION DE PERFORMANCE	12
INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)	13
INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE	14
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS	15
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS	16
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE	17
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT	18
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS	19
INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	20
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	21
SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE	22

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR

Éléments 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	2 320 362,45
b) Avoirs bancaires	140 883,07
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	0,00
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	2 461 245,52
e) Passif	-5 129,39
f) Valeur nette d'inventaire	2 456 116,13

* Les montants sont signés

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

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

Code ISIN de la part	Libellé de la part	Affectation des sommes distribuables	Devise de la part	Actif net de la part (EUR)	Nombre de parts	Valeur liquidative (EUR)
FR001400R3Y8	PART CAPI A	Capitalisable	EUR	1 004 436,25	10 000,0000	100,44
FR001400NLU7	PART CAPI C	Capitalisable	EUR	1 451 679,88	14 401,0000	100,80

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR

Eléments du portefeuille titres:	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Titres financiers éligibles et 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	94,47	94,28
b) Titres financiers éligibles et 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
c) Titres financiers éligibles et 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	0,00
d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Autres actifs	0,00	0,00

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

Eléments du portefeuille titres:	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
a) Titres financiers éligibles et 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	2 415 842,33	100 000,00
b) Titres financiers éligibles et 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
c) Titres financiers éligibles et 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	0,00
d) Titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Autres actifs	0,00	0,00

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	2 415 842,33
Cessions	100 000,00

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Pas de distribution sur la période.

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR DEVISE

Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
		Actif net	Total des actifs
Euro	2 320 362,45	94,47	94,28
Total	2 320 362,45	94,47	94,28

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

RÉPARTITION DES ACTIFS A), B), C) ET D) PAR SECTEUR ÉCONOMIQUE

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Souverains	49,09	48,99
Assurances multirisques	12,42	12,40
Services de soutien aux entreprises	8,44	8,42
Banques	4,37	4,36
Voyage et Loisirs	4,11	4,10
Industries généralistes	4,10	4,10
Téléphonie fixe	4,06	4,05
Automobiles et équipementiers	4,03	4,02
Téléphonie mobile	3,85	3,84
Total	94,47	94,28

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C) ET D) PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	24,99	24,94
Pays-Bas	20,25	20,22
Belgique	12,54	12,51
Portugal	8,41	8,39
Italie	8,21	8,20
Allemagne	8,05	8,03
Espagne	7,91	7,89
États-Unis	4,11	4,10
Total	94,47	94,28

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

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

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Parts d'OPC	0,00	0,00
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	0,00	0,00
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	0,00	0,00
Autres OPC et fonds d'investissements	0,00	0,00
Autres actifs	0,00	0,00
Total	0,00	0,00

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

COMMISSION DE PERFORMANCE

PART CAPI A	30/09/2024
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance	0,00

PART CAPI C	30/09/2024
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance	0,00

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instrument	Devise	Quantité	Montant	%AN
Obligations			2 320 362,45	94,47
Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			2 320 362,45	94,47
Assurances multirisques			305 105,01	12,42
ASR NEDERLAND 5,125%15-290945	EUR	100	101 229,12	4,12
AXA TV14-PERP.EMTN	EUR	100	103 488,36	4,21
BNP CARDIF 1%17-291124	EUR	1	100 387,53	4,09
Automobiles et équipementiers			98 975,11	4,03
VW INTL FINANCE TV18-PERP.	EUR	1	98 975,11	4,03
Banques			107 318,11	4,37
CRELAN 5,375%22-311025	EUR	1	107 318,11	4,37
Industries généralistes			100 788,22	4,10
ABERTIS 3,248% PERP	EUR	1	100 788,22	4,10
Services de soutien aux entreprises			207 354,62	8,44
LOXAM 3,75%0726	EUR	100	100 858,58	4,11
LOXAM 6,375%23-150528	EUR	100	106 496,04	4,33
Souverains			1 205 697,63	49,09
ALLEMAGNE 1%15-150825	EUR	20 000 000	197 711,01	8,05
BELGIQUE 0,5%17-221024	EUR	20 000 000	200 661,36	8,17
ITALY 3,6%23-290925	EUR	200	201 767,66	8,21
OAT 1,75%14-25112024	EUR	200 000	202 521,61	8,25
PAYS-BAS 0,25%15-150725	EUR	200 000	196 516,22	8,00
PORTUGAL 2,875%15-151025	EUR	20 000 000	206 519,77	8,41
Téléphonie fixe			99 687,89	4,06
LORCA TELE BNDC 4%20-180927	EUR	100	99 687,89	4,06
Téléphonie mobile			94 571,58	3,85
CELLNEX FINANCE 1%21-150927	EUR	1	94 571,58	3,85
Voyage et Loisirs			100 864,28	4,11
INTER GAME TECH 3,5%19-150626	EUR	100	100 864,28	4,11
Total			2 320 362,45	94,47

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE

Libellé instrument	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)			
	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.

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS

Instruments financiers à terme – actions				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		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.

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS

Instruments financiers à terme – taux d'intérêts				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		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.

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE

Instruments financiers à terme – de change				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		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.

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT

Instruments financiers à terme – sur risque de crédit				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		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.

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS

Instruments financiers à terme – autres expositions				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		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.

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)

Libellé instrument	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)				Classe de part couverte
	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.

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)

Libellé instrument	Quantité/ Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)	Classe de part couverte
		Actif	Passif	+/-	
Futures					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Options					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Swaps					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Autres instruments					
Sous total		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.

SELECT RENDEMENT OBLIGATAIRE

SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	2 320 362,45
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 (+)	140 883,07
Autres passifs (-)	-5 129,39
Total = actif net	2 456 116,13