

LA FRANCAISE CONVERTIBLES DYNAMIQUE

Fonds Commun de Placement

Société de Gestion :
La Française Asset Management

128, boulevard Raspail
75006 Paris

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

au 30 juin 2021

LA FRANCAISE CONVERTIBLES DYNAMIQUE

Fonds Commun de Placement

Société de Gestion :
La Française Asset Management

128, boulevard Raspail
75006 Paris

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

au 30 juin 2021

En notre qualité de commissaire aux comptes du Fonds Commun de Placement LA FRANCAISE CONVERTIBLES DYNAMIQUE 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 2021 ci-jointe.

Ces informations ont été établies sous la responsabilité de la société de gestion sur la base des éléments disponibles dans un contexte évolutif de crise liée au Covid-19. 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 25 août 2021

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés



Virginie GAITTE



Fonds: LF CONVERTIBLES DYNAMIQUE (PFP012) EUR

Date de VL: 30/06/2021

Classe (VL)		Code ISIN Part	Actif Net Part en Dev. de Réf.		Nb. Parts		Disponibilités	VL (dev part) 6/30/21		VL préc. (dev part) 6/29/21		Var. VL (%)	Statut
I cap		FR0007053269	3,667,741.080000		2,194,9352700000		146,715.27	1,671.000000		1,677.2		-0.37	VAL
P cap		FR0010678490	2,685,259.130000		17,991,06300000000		146,715.27	149.250000		149.81		-0.37	VAL

Code valeur	Lib. court valeur	Libellé type instrument	Quantité	Dev cot	S/C	PRU (dev cot)	Cours	Dt cours	Orig	PRT (dev réf)	VBT (dev réf)	CCT (dev réf)	PMVT (dev réf)	Actif net
5110300	Cash BP2S BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES	Disponibilités	10,581,5800000000	CHF							9,652.96			0.1519
			Total devise :				CHF				9,652.96			0.1519
4030000	Rachats a regler	Disponibilités	-2,743.7600000000	EUR							-2,743.76			-0.0432
44130100	Coupons détachés / obligation	Disponibilités	2,000.0000000000								2,000.00			0.0315
4630100	Frais et commissions à payer	Disponibilités	-2,531.8000000000								-2,531.80			-0.0399
4660000	Reliquat FDG fonct	Disponibilités	54.2400000000								54.24			0.0009
4662000	Reliquat FDG valorisateur	Disponibilités	5,205.0800000000								5,205.08			0.0819
4663000	Reliquat FDG depositaire	Disponibilités	8,428.6100000000								8,428.61			0.1327
4664000	Controparte Debito da equalizz. 46	Disponibilités	227.8900000000								227.89			0.0036
4881000	Reliquat FDG Hon CAC	Disponibilités	-3,046.5000000000								-3,046.50			-0.0480
4882000	Prov honoraires CAC	Disponibilités	-357.8400000000								-357.84			-0.0056
4884000	Prov frais valorisateur	Disponibilités	-736.7200000000								-736.72			-0.0116
4885010	Prov frais depositaire	Disponibilités	-2,859.0800000000								-2,859.08			-0.0450
4885200	Prov frais de gest financ 13C	Disponibilités	-3,204.0600000000								-3,204.06			-0.0504
4889010	Frais de fonctionnement 13C	Disponibilités	-180.5600000000								-180.56			-0.0028
4889200	Frais de fonctionnement 24C	Disponibilités	-132.9200000000								-132.92			-0.0021
4897010	Prov FDG variables 13C	Disponibilités	-6,347.6000000000								-6,347.60			-0.0999
4897200	Prov FDG variables 24C	Disponibilités	-3,349.6300000000								-3,349.63			-0.0527
4898200	Prov FDG variables acquis 24C	Disponibilités	-27.9200000000								-27.92			-0.0004
5110300	Cash BP2S BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES	Disponibilités	23,800.2300000000								23,800.23			0.3746
5110380	Cash Newedge NEWEDGE	Disponibilités	93,924.2000000000								93,924.20			1.4784
			Total devise :				EUR				108,121.86			1.7019



Fonds: LF CONVERTIBLES DYNAMIQUE (PFP012) EUR

Date de VL: 30/06/2021

Code valeur	Lib. court valeur	Libellé type instrument	Quantité	Dev cot	S/C	PRU (dev cot)	Cours	Dt cours	Orig	PRT (dev réf)	VBT (dev réf)	CCT (dev réf)	PMVT (dev réf)	Actif net
5110300	Cash BP2S BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES	Disponibilités	17,188.2500000000	GBP							20,022.42			0.3152
			Total devise :		GBP						20,022.42			0.3152
5110300	Cash BP2S BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES	Disponibilités	10,575.8900000000	USD							8,918.03			0.1404
			Total devise :		USD						8,918.03			0.1404
Total instrument: Disponibilités														
CH0413990240	SIKA AG 0.15%	Obligations	200,000.0000000000	CHF		103.210725	160.64	30/06/2021	ontribut	178,574.05	293,096.61	20.53	114,522.56	4.6135
Total devise :														
BE6302890247	ECONOCOM GROU 0.5%	Obligations	4,211.0000000000	EUR		8.260000	7.64	30/06/2021	ontribut	34,782.86	32,150.99	55.27	-2,631.87	0.5061
BE6327660591	SAGERPAR 0%	Obligations	200,000.0000000000			101.250000	100.97	30/06/2021	ontribut	202,500.00	201,944.00	0.00	-556.00	3.1787
DE000A2BPB84	DEUTSCHE WOHNEN 0.325%	Obligations	200,000.0000000000			107.627875	132.19	30/06/2021	ontribut	215,255.75	264,982.26	607.26	49,726.51	4.1710
DE000A2G87D4	DEUTSCHE POST AG 0.05%	Obligations	100,000.0000000000			109.213420	122.19	30/06/2021	ontribut	109,213.42	122,219.03	27.53	13,005.61	1.9238
DE000A2GSDH2	LEG IMMOBILIEN 0.875%	Obligations	100,000.0000000000			115.632030	125.85	30/06/2021	ontribut	115,632.03	126,137.83	292.46	10,505.80	1.9855
DE000A2LQRA1	RAG STIFTUNG 0%	Obligations	100,000.0000000000			98.000000	102.15	30/06/2021	ontribut	98,000.00	102,150.00	0.00	4,150.00	1.6079
DE000A3E44N7	RAG STIFTUNG 0%	Obligations	100,000.0000000000			100.850000	114.61	30/06/2021	ontribut	100,850.00	114,610.00	0.00	13,760.00	1.8040
DE000A3E46Y9	TAG IMMO AG 0.625%	Obligations	100,000.0000000000			101.070000	103.89	30/06/2021	ontribut	101,070.00	104,099.04	214.04	3,029.04	1.6386
DE000SYM7787	SYMRISE AG 0.2375%	Obligations	100,000.0000000000			109.081630	130.29	30/06/2021	ontribut	109,081.63	130,297.31	7.81	21,215.68	2.0510
FR0013200995	REMY COINTREAU 0.125%	Obligations	330,000.0000000000			133.705273	176.61	30/06/2021	ontribut	44,122.74	58,279.82	37.03	14,157.08	0.9174
FR0013218807	SEB SA 0%	Obligations	500,000.0000000000			197.605500	183.86	30/06/2021	ontribut	98,802.75	91,932.00	0.00	-6,870.75	1.4471
FR0013266087	KORIAN SA 17-31/12/2049 FLAT	Obligations	2,500.0000000000			42.331680	42.50	30/06/2021	ontribut	105,829.20	106,245.00	1,249.58	415.80	1.6724
FR0013284130	ARCHER OBLIGAT 0%	Obligations	100,000.0000000000			108.696660	179.11	30/06/2021	ontribut	108,696.66	179,108.00	0.00	70,411.34	2.8193
FR0013300381	MAISONS DU M 0.125%	Obligations	2,700.0000000000			52.057522	46.60	30/06/2021	ontribut	140,555.31	125,818.65	92.92	-14,736.66	1.9805
FR0013418795	ORPEA 0.375%	Obligations	900.0000000000			148.135600	148.86	30/06/2021	ontribut	133,322.04	133,972.65	59.60	650.61	2.1088
FR0013439304	WORLDLINE SA 0%	Obligations	800.0000000000			109.817163	114.05	30/06/2021	ontribut	87,853.73	91,242.40	0.00	3,388.67	1.4362
FR0013444148	VEOLIA ENVRNMT 0%	Obligations	3,000.0000000000			31.738570	32.38	30/06/2021	ontribut	95,215.71	97,143.00	0.00	1,927.29	1.5291



Fonds: LF CONVERTIBLES DYNAMIQUE (PFP012) EUR

Date de VL: 30/06/2021

Code valeur	Lib. court valeur	Libellé type instrument	Quantité	Dev cot	S/C	PRU (dev cot)	Cours	Dt cours	Orig	PRT (dev réf)	VBT (dev réf)	CCT (dev réf)	PMVT (dev réf)	Actif net
FR0013448412	UBISOFT ENTERTAI 0%	Obligations	900,000,000,000,000			120,466766	113.79	30/06/2021	ontribut	108,420.08	102,411.00	0.00	-6,009.08	1,6120
FR0013450483	KERING 0% 19-30/09/2022 CV	Obligations	100,000,000,000,000,000			108,750000	114.96	30/06/2021	ontribut	108,750.00	114,964.00	0.00	6,214.00	1,8096
FR0013457942	ATOS SE 0% 19-06/11/2024 CV	Obligations	100,000,000,000,000,000			108,875000	126.10	30/06/2021	ontribut	108,875.00	126,103.50	0.00	17,228.50	1,9849
FR0013513041	SAFRAN SA 0.875% 20-15/05/2027 CV FLAT	Obligations	1,140,000,000,000,000			121,125000	140.51	30/06/2021	ontribut	138,082.50	160,186.53	136.06	22,104.03	2,5214
FR0013520681	SELENA 0% 20-25/06/2025 CV	Obligations	100,000,000,000,000,000			106,800000	122.83	30/06/2021	ontribut	106,800.00	122,829.00	0.00	16,029.00	1,9334
FR0013521085	ACCOR 0.7% 20-07/12/2027 CV FLAT	Obligations	1,100,000,000,000,000			50,205482	52.68	30/06/2021	ontribut	55,226.03	57,944.15	208.10	2,718.12	0,9121
FR0013526803	WORLDLINE SA 0% 20-30/07/2025 CV	Obligations	260,000,000,000,000			125,490000	123.31	30/06/2021	ontribut	32,627.40	32,059.30	0.00	-568.10	0,5046
FR0013534518	ELEC DE FRANCE 0% 20-14/09/2024 CV	Obligations	12,675,000,000,000,000			11,974154	15.16	30/06/2021	ontribut	151,772.40	192,089.63	0.00	40,317.23	3,0236
FR001400OOG2	SCHNEIDER 0.000001% 20-15/06/26 CV FLAT	Obligations	486,000,000,000,000			190,182016	196.45	30/06/2021	ontribut	92,428.46	95,472.27	0.00	3,043.81	1,5028
FR0014003RF1	ENGIE 0% 21-02/06/2024 CV	Obligations	800,000,000,000,000			83,765000	82.68	30/06/2021	ontribut	67,012.00	66,142.00	0.00	-870.00	1,0411
FR0014003Z32	SAFRAN SA 0% 21-01/04/2028 CV	Obligations	312,000,000,000,000			187,046923	182.70	30/06/2021	ontribut	58,358.64	57,003.18	0.00	-1,355.46	0,8973
XS1321004118	IBERDROLA INTL 0% 15-11/11/2022 CV	Obligations	100,000,000,000,000,000			108,442770	122.65	30/06/2021	ontribut	108,442.77	122,648.50	0.00	14,205.73	1,9306
XS1322536506	INTL CONSOLIDAT 0.625% 16-07/10/2023 CV	Obligations	100,000,000,000,000,000			88,836340	97.40	30/06/2021	ontribut	88,836.34	97,478.13	78.13	8,641.79	1,5344
XS1373990834	GRAND CITY PROP 0.25% 16-02/03/2022 CV	Obligations	100,000,000,000,000,000			106,102450	103.21	30/06/2021	ontribut	106,102.45	103,290.88	82.88	-2,811.57	1,6259
XS1492150260	CO ECONOMICA 1% 16-01/12/2023 CV	Obligations	100,000,000,000,000,000			100,995980	101.15	30/06/2021	ontribut	100,995.98	101,229.70	84.70	233.72	1,5934
XS1500463358	INDRA SISTEMAS S 1.25% 16-07/10/2023 CV	Obligations	100,000,000,000,000,000			106,342250	100.58	30/06/2021	ontribut	106,342.25	100,869.09	293.72	-5,473.16	1,5877
XS15683310807	SNAM 0% 17-20/03/2022 CV	Obligations	100,000,000,000,000,000			108,000000	105.77	30/06/2021	ontribut	108,000.00	105,768.50	0.00	-2,231.50	1,6649
XS1750026186	CELLNEX TELECOM 1.5% 18-16/01/2026 CV	Obligations	100,000,000,000,000,000			102,168160	184.66	30/06/2021	ontribut	102,168.16	185,341.30	686.30	83,173.14	2,9174
XS1783932863	ENCE ENRGA Y CEL 1.25% 18-05/03/2023 CV	Obligations	100,000,000,000,000,000			105,732350	98.46	30/06/2021	ontribut	105,732.35	98,859.21	404.21	-6,873.14	1,5561
XS2021212332	CELLNEX TELECOM 0.5% 19-05/07/2028 CV	Obligations	100,000,000,000,000,000			121,367210	136.93	30/06/2021	ontribut	121,367.21	137,425.89	495.89	16,058.68	2,1632
XS2154448059	AMADEUS IT GROUP 1.5% 20-09/04/2025 CV	Obligations	100,000,000,000,000,000			123,530070	135.69	30/06/2021	ontribut	123,530.07	136,030.26	344.26	12,500.19	2,1412
XS2161819722	NEXI 1.75% 20-24/04/2027 CV	Obligations	100,000,000,000,000,000			100,000000	123.73	30/06/2021	ontribut	100,000.00	124,062.21	330.82	24,062.21	1,9528
XS2198575271	LAGFIN 2% 20-02/07/2025 CV	Obligations	100,000,000,000,000,000			100,125000	123.29	30/06/2021	ontribut	100,125.00	123,287.50	0.00	23,162.50	1,9406



Fonds: LF CONVERTIBLES DYNAMIQUE (PFP012) EUR

Date de VL: 30/06/2021

Code valeur	Lib. court valeur	Libellé type instrument	Quantité	Dev cot	S/C	PRU (dev cot)	Cours	Dt cours	Orig	PRT (dev réf)	VBT (dev réf)	CCT (dev réf)	PMVT (dev réf)	Actif net
XS2240512124	OLIVER CAPITAL 0%	Obligations	100,000,000,000,000			102,749000	107.36	30/06/2021	ontribut	102,749.00	107,360.00	0.00	4,611.00	1.6899
XS2294704007	PRYSMIAN SPA 0%	Obligations	100,000,000,000,000			101,100000	101.33	30/06/2021	ontribut	101,100.00	101,326.00	0.00	226.00	1.5949
XS2305842903	NEXI 0% 21-24/02/2028 CV	Obligations	100,000,000,000,000			100,000000	101.27	30/06/2021	ontribut	100,000.00	101,273.05	0.00	1,273.05	1.5941
XS2352315571	JP MORGAN CHASE 0%	Obligations	200,000,000,000,000			111,750000	112.16	30/06/2021	ontribut	223,500.00	224,320.00	0.00	820.00	3.5309
			Total devise :	EUR			4,728,127.92			5,180,106.76	5,788.57		451,978.84	81,5380
XS1327914062	TOTALENERGIES SE 0.5%	Obligations	200,000,000,000,000	USD		106,044780	101.74	30/06/2021	ontribut	179,980.51	171,658.93	70.27	-8,321.58	2.7020
XS1908221507	QIAGEN NV 1%	Obligations	200,000,000,000,000			103,984720	121.67	30/06/2021	ontribut	183,929.76	205,418.96	229.55	21,489.20	3.2334
XS2211997155	STIMICROELECTRON 0%	Obligations	200,000,000,000,000			119,940000	120.38	30/06/2021	ontribut	201,131.93	203,023.86	0.00	1,891.93	3.1957
			Total devise :	USD			565,042.20			580,101.75	299.82		15,059.55	9.1311
Total instrument: Obligations							5,471,744.17			6,053,305.12	6,108.92		581,560.95	95,2826
Contrat d achat a terme														
EURCHF300721265PFP	Achat EUR 18,244.81 Vente CHF 20.0	Change à Terme	-20,000,000,000,000	CHF	V	1.096202	1.10			-18,244.81	0.00			0.0000
			Total devise :	CHF			-18,244.81			0.00				0.0000
Contrat d achat a terme														
EURCHF300721265PFP	Achat EUR 18,244.81 Vente CHF 20.0	Change à Terme	18,244,810,000,000	EUR	A	1.096202	1.10			18,244.81	-2.70		-2.70	0.0000
Contrat d achat a terme														
GBPEUR300721264PFP	Achat GBP 240,000.00 Vente EUR 279	Change à Terme	-279,108,190,000,000		V	1.162951	0.86			-279,108.19	0.00			0.0000
Contrat d achat a terme														
USDEUR300721266PFP	Achat USD 440,000.00 Vente EUR 368	Change à Terme	-368,526,650,000,000		V	0.837561	1.19			-368,526.65	0.00			0.0000
			Total devise :	EUR			-629,390.03			-2.70	-2.70		-2.70	0.0000
Contrat d achat a terme														
GBPEUR300721264PFP	Achat GBP 240,000.00 Vente EUR 279	Change à Terme	240,000,000,000,000	GBP	A	1.162951	0.86			279,108.19	327.14		327.14	0.0051
			Total devise :	GBP			279,108.19			327.14			327.14	0.0051
Contrat d achat a terme														
USDEUR300721266PFP	Achat USD 440,000.00 Vente EUR 368	Change à Terme	440,000,000,000,000	USD	A	0.837561	1.19			368,526.65	2,297.08		2,297.08	0.0362
			Total devise :	USD			368,526.65			2,297.08			2,297.08	0.0362
Total instrument: Change à Terme														
							0.00			2,621.52			2,621.52	0.0413
LF TRESORERIE ISR														
FR0010609115	PART I	OPCVM	1,400,000,000	EUR		107,419,250000	107,398.80	29/06/2021	ontribut	150,386.95	150,358.32	0.00	-28.63	2.3667
			Total devise :	EUR			150,386.95					0.00	-28.63	2.3667



Fonds: LF CONVERTIBLES DYNAMIQUE (PFP012) EUR

Date de VL: 30/06/2021

Code valeur	Lib. court valeur	Libellé type instrument	Quantité	Dev cot	S/C	PRU (dev cot)	Cours	Dt cours	Orig	PRT (dev réf)	VBT (dev réf)	CCT (dev réf)	PMVT (dev réf)	Actif net
Total instrument: OPCVM														
FONDS:	LF CONVERTIBLES DYNAMIQUE (PFP012)	EUR								150,386.95	150,358.32	0.00	-28.63	2.3667
										5,622,131.12	6,353,000.23	6,108.92	584,153.84	100.0000