



EDMOND
DE ROTHSCHILD

INVENTAIRE DE PORTEFEUILLE ISR

EDMOND DE ROTHSCHILD SICAV EURO
SUSTAINABLE CREDIT





**INVENTAIRE EDMOND DE ROTHSCHILD SICAV EURO SUSTAINABLE CREDIT
AU 31/01/2024**

Type d'instrument	Nom	ESG BUILD MSCI	Poids (%)	Eligibilité de la note ESG
Obligation	LLOYDS 4.947 PERP	12,2	0,69%	Oui
Obligation	AXASA 3 7/8 PERP	14,3	0,75%	Oui
Obligation	NNGRNV 4 1/2 PERP	13,1	0,61%	Oui
Obligation	SCOR 3 7/8 PERP	13,3	0,52%	Oui
Obligation	ASSGEN 4.596 PERP	12,4	0,30%	Oui
Obligation	ASSGEN 4.596 PERP	12,4	0,08%	Oui
Obligation	BNP 4.032 PERP	12,3	0,56%	Oui
Obligation	SOGESA 4 1/8 PERP	11	0,77%	Oui
Obligation	ACAFP 4 1/4 PERP	11	0,60%	Oui
Obligation	SPPEUS 2 5/8 02/12/25	10,8	0,56%	Oui
Obligation	ACHMEA 4 1/4 PERP	13,7	0,43%	Oui
Obligation	SRENVX 2.6 PERP	14,6	0,48%	Oui
Obligation	ASSGEN 5 06/08/48	12,4	0,56%	Oui
Obligation	SUFP 0 1/4 09/09/24	15,2	0,70%	Oui
Obligation	MS 1 3/8 10/27/26	11,6	0,97%	Oui
Obligation	ISPIM 7 3/4 PERP	13,1	0,39%	Oui
Obligation	MAPSM 4 3/8 03/31/47	11,8	0,58%	Oui
Obligation	MS 1 7/8 04/27/27	11,6	0,62%	Oui
Obligation	CABKSM 1 1/8 05/17/24	12,1	0,82%	Oui
Obligation	HSBC 4 3/4 PERP	11,4	0,69%	Oui
Obligation	HSBC 4 3/4 PERP	11,4	0,07%	Oui
Obligation	ARGID 4 3/4 07/15/27	10,1	0,49%	Oui
Obligation	KBCBB 1 5/8 09/18/29	12,8	0,92%	Oui
Obligation	ACAFP 3 1/4 10/04/24	11	0,51%	Oui
Obligation	TALANX 2 1/4 12/05/47	11,7	0,56%	Oui
Obligation	SANTAN 2 1/8 02/08/28	11,5	0,61%	Oui
Obligation	ENELIM 1 1/8 09/16/26	13	0,25%	Oui
Obligation	CAPFP 1 10/18/24	12,7	0,55%	Oui
Obligation	SOCGEN 6 3/4 PERP	11	0,32%	Oui
Obligation	URWFP 2 7/8 PERP	11,6	0,36%	Oui
Obligation	EDPPL 1 5/8 01/26/26	12,8	0,87%	Oui
Obligation	CNPFP 4 3/4 PERP	11,9	0,48%	Oui
Obligation	PHNXLN 4 3/8 01/24/29	12,5	0,38%	Oui
Obligation	BNP 2 3/8 11/20/30	12,3	0,62%	Oui
Obligation	CNPFP 2 3/4 02/05/29	11,9	0,41%	Oui
Obligation	SRGIM 1 1/4 08/28/25	13	0,47%	Oui
Obligation	MDT 1 1/8 03/07/27	12,2	0,97%	Oui
Obligation	ERSTBK 5 1/8 PERP	11	0,51%	Oui
Obligation	KBCBB 4 3/4 PERP	12,8	0,38%	Oui
Obligation	KBCBB 4 3/4 PERP	12,8	0,08%	Oui
Obligation	SBBBSS 1 3/4 01/14/25	11,3	0,13%	Oui
Obligation	LRFP 0 5/8 06/24/28	16,5	1,02%	Oui
Obligation	BBVASM 1 06/21/26	12	0,36%	Oui



EDMOND DE ROTHSCHILD

Obligation	ENAPHO 1.698 07/30/26	NR	0,17%	NA
Obligation	BNP 0 1/8 09/04/26	12,3	0,35%	Oui
Obligation	RABOBK 3 1/4 PERP	10,5	0,89%	Oui
Obligation	RABOBK 3 1/4 PERP	10,5	0,07%	Oui
Obligation	TMO 0 1/8 03/01/25	12,2	0,65%	Oui
Obligation	DSYFP 0 1/8 09/16/26	14,5	0,35%	Oui
Obligation	ENAPHO 2.045 10/09/28	NR	0,12%	NA
Obligation	BKIR 2 3/8 10/14/29	10,7	0,48%	Oui
Obligation	LAMON 4 3/8 PERP	NR	0,45%	NA
Obligation	ARDFIN 5 06/30/27	10,1	0,19%	Oui
Obligation	TOYOTA 0 1/4 07/16/26	11,4	0,70%	Oui
Obligation	MRKGR 0 1/8 07/16/25	11,3	0,54%	Oui
Obligation	ISPIM 5 7/8 PERP	13,1	0,49%	Oui
Obligation	SBBBSS 1 08/12/27	11,3	0,05%	Oui
Obligation	BKTSM 0 5/8 10/06/27	12,6	0,17%	Oui
Obligation	SUFP 0 1/4 03/11/29	15,2	0,73%	Oui
Obligation	SHBASS 1 04/15/25	12,6	1,05%	Oui
Obligation	BNP 1 1/8 04/17/29	12,3	0,68%	Oui
Obligation	GIVNVX 1 04/22/27	13,9	0,71%	Oui
Obligation	ASML 0 5/8 05/07/29	16,1	0,74%	Oui
Obligation	NESNVX 1 1/8 04/01/26	10	0,58%	Oui
Obligation	FRPTT 0 5/8 10/21/26	13,3	0,42%	Oui
Obligation	BPCEGP 0 5/8 04/28/25	12,4	0,58%	Oui
Obligation	SANTAN 1 3/8 01/05/26	11,5	0,72%	Oui
Obligation	NESNVX 0 11/12/24	10	0,19%	Oui
Obligation	SAPGR 0 3/8 05/18/29	13,5	1,00%	Oui
Obligation	CFRVX 0 3/4 05/26/28	11,3	0,28%	Oui
Obligation	DBOERS 1 1/4 06/16/47	12,4	0,17%	Oui
Obligation	IFXGR 2 06/24/32	10,9	0,75%	Oui
Obligation	BBVASM 6 PERP	12	0,89%	Oui
Obligation	ACAFP 2 07/17/30	11	0,33%	Oui
Obligation	SPPEUS 1 5/8 06/25/27	10,8	0,32%	Oui
Obligation	TRNIM 0 3/4 07/24/32	13,9	0,64%	Oui
Obligation	VOD 2 5/8 08/27/2080	13,4	0,36%	Oui
Obligation	JCI 0 3/8 09/15/27	12,8	0,50%	Oui
Obligation	PRAEFP 1 3/8 09/17/30	13,4	0,73%	Oui
Obligation	CABKSM 5 7/8 PERP	12,1	0,44%	Oui
Obligation	AMSSM 1 7/8 09/24/28	12,3	0,40%	Oui
Obligation	INFLN 2 1/8 10/06/25	14,5	0,62%	Oui
Obligation	ASABRE 0.155 10/23/24	12,7	0,55%	Oui
Obligation	ABESM 3.248 PERP	13,9	0,75%	Oui
Obligation	FRLBP 0 3/4 08/02/32	13,7	0,63%	Oui
Obligation	HTHROW 2 3/4 10/13/29	14,2	1,11%	Oui
Obligation	ENAPHO 1.816 03/02/31	NR	0,03%	NA
Obligation	ENAPHO 1.816 03/02/31	NR	0,09%	NA
Obligation	PFLEID 4 3/4 04/15/26	NR	0,47%	NA
Obligation	CWHARF 1 3/4 04/07/26	NR	0,03%	NA
Obligation	SBBBSS 1 1/8 11/26/29	11,3	0,10%	Oui



EDMOND DE ROTHSCHILD

Obligation	BKTSM 1 1/4 12/23/32	12,6	0,33%	Oui
Obligation	BKIR 6 PERP	10,7	0,76%	Oui
Obligation	MACIFS 3 1/2 PERP	11,8	0,29%	Oui
Obligation	POSIM 2 5/8 PERP	13,4	0,32%	Oui
Obligation	HEIBOS 0 3/4 09/06/29	NR	0,13%	NA
Obligation	CASTSS 3 1/8 PERP	15,4	0,32%	Oui
Obligation	SAUR 0 1/8 09/16/25	11,3	0,60%	Oui
Obligation	SAUR 0 5/8 09/16/28	11,3	0,52%	Oui
Obligation	HEIBOS 1 5/8 10/13/31	NR	0,03%	NA
Obligation	TDFINF 1 3/4 12/01/29	NR	0,75%	NA
Obligation	BPCEGP 1 5/8 01/14/25	12,4	0,33%	Oui
Obligation	MA 1 02/22/29	12,4	0,80%	Oui
Obligation	TRNIM 2 3/8 PERP	13,9	0,29%	Oui
Obligation	CERTEC 5 1/4 02/15/30	NR	0,52%	NA
Obligation	CERVIM Float 02/15/29	NR	0,55%	NA
Obligation	ISPIM 6 3/8 PERP	13,1	0,44%	Oui
Obligation	VWSDC 1 1/2 06/15/29	15,1	0,10%	Oui
Obligation	SSELN 4 PERP	16,2	0,40%	Oui
Obligation	ENELIM 4 1/4 06/15/25	13	0,41%	Oui
Obligation	SOCGEN 4.351 06/13/25	11	0,34%	Oui
Obligation	BACR 8 PERP	12,3	0,44%	Oui
Obligation	SLHNVX 3 1/4 08/31/29	11,8	1,04%	Oui
Obligation	ISPIM 4 3/4 09/06/27	13,1	0,39%	Oui
Obligation	BNP 3 5/8 09/01/29	12,3	0,65%	Oui
Obligation	BKIR 6.253 09/16/26	10,7	0,71%	Oui
Obligation	ENELIM 7 1/2 10/14/32	13	0,28%	Oui
Obligation	ORSTED 5 1/4 12/08/3022	14,4	0,54%	Oui
Obligation	SOCGEN 4 1/4 11/16/32	11	0,40%	Oui
Obligation	KBCBB 4 3/8 11/23/27	12,8	0,39%	Oui
Obligation	ANNGR 5 11/23/30	10,9	0,56%	Oui
Obligation	ATOSTR 4 3/4 01/24/31	10,6	0,97%	Oui
Obligation	REESM 4 5/8 PERP	13,3	0,31%	Oui
Obligation	PLD 3 7/8 01/31/30	12,1	0,51%	Oui
Obligation	SABSM 9 3/8 PERP	11,3	0,72%	Oui
Obligation	HOUSEH 9 11/03/29	10,1	0,60%	Oui
Obligation	SOCGEN 7 7/8 PERP	11	0,89%	Oui
Obligation	BNP 7 3/8 PERP	12,3	0,88%	Oui
Obligation	BKTSM 7 3/8 PERP	12,6	0,85%	Oui
Obligation	NESVFH 3 7/8 03/16/29	13,8	0,50%	Oui
Obligation	VWSDC 4 1/8 06/15/26	15,1	0,59%	Oui
Obligation	ASSGEN 5.399 04/20/33	12,4	0,12%	Oui
Obligation	SYDAU 4 3/8 05/03/33	17,6	0,93%	Oui
Obligation	DGELN 3 1/2 06/26/25	16,5	0,57%	Oui
Obligation	NNGRNV 6 11/03/43	13,1	0,67%	Oui
Obligation	SANTAN 5 3/4 08/23/33	11,5	0,28%	Oui
Obligation	PELHOL 9 1/2 04/01/27	NR	0,59%	NA
Obligation	PLD 4 5/8 05/23/33	12,1	1,23%	Oui
Obligation	LONNVX 3 7/8 05/25/33	11,9	1,00%	Oui



EDMOND DE ROTHSCHILD

Obligation	WPPLN 4 1/8 05/30/28	13,8	0,16%	Oui
Obligation	TDCDC 6 1/2 06/01/31	12,7	1,39%	Oui
Obligation	VOD 8 08/30/2086	13,4	0,49%	Oui
Obligation	STERV 4 06/01/26	11,4	0,58%	Oui
Obligation	MWDP 4 1/2 06/19/30	10,5	0,92%	Oui
Obligation	SANTAN 4 1/4 06/12/30	11,5	0,76%	Oui
Obligation	LIN 3 5/8 06/12/25	12	0,77%	Oui
Obligation	UNIMUS 4 06/13/31	12,6	0,58%	Oui
Obligation	MBGGR 3 5/8 12/16/24	11,2	0,56%	Oui
Obligation	ATOSTR 5 1/8 06/14/33	10,6	0,49%	Oui
Obligation	RY 4 1/8 07/05/28	12,3	1,38%	Oui
Obligation	BBVASM 8 3/8 PERP	12	0,16%	Oui
Obligation	ACHMEA 6 3/4 12/26/43	13,7	0,17%	Oui
Obligation	PRFINE 9 3/8 07/15/28	NR	0,39%	NA
Obligation	SMDSLN 4 3/8 07/27/27	9,9	0,41%	Oui
Obligation	TELEFO 6 3/4 PERP	11,2	0,83%	Oui
Obligation	SECUSS 4 3/8 03/06/29	11,8	0,71%	Oui
Obligation	MCFP 3 1/4 09/07/29	11,2	1,27%	Oui
Obligation	SSELN 4 09/05/31	16,2	0,59%	Oui
Obligation	IPGIM 7 09/27/28	12,3	0,40%	Oui
Obligation	LSELN 4 1/8 09/29/26	12,3	0,99%	Oui
Obligation	ERSTBK 8 1/2 PERP	11	0,49%	Oui
Obligation	SRTGR 4 1/4 09/14/26	12,6	0,39%	Oui
Obligation	SRTGR 4 3/8 09/14/29	12,6	0,40%	Oui
Obligation	SRTGR 4 7/8 09/14/35	12,6	0,33%	Oui
Obligation	BCPPL 5 5/8 10/02/26	11,5	0,39%	Oui
Obligation	PURGYM 8 1/4 10/11/28	NR	0,59%	NA
Obligation	VPARKI 4 1/2 04/18/30	NR	0,87%	NA
Obligation	EGBLFN 11 11/30/28	NR	0,69%	NA
Obligation	F 5 1/8 02/20/29	10,1	0,35%	Oui
Obligation	URWFP 4 1/8 12/11/30	11,6	0,38%	Oui
Obligation	SYABGR 7 7/8 01/31/31	NR	0,46%	NA
Obligation	ASRNED 3 5/8 12/12/28	14,2	0,09%	Oui
Obligation	LOXAM 6 3/8 05/31/29	12,4	0,37%	Oui
Obligation	ALVGR 4.851 07/26/54	12,6	0,46%	Oui
Obligation	EDP 6.5Y EUR	12,8	0,34%	Oui
Obligation	AXASA 6 3/8 PERP	14,3	0,31%	Oui
Obligation	TPEIR 7 1/4 04/17/34	10,1	0,77%	Oui
Obligation	WEPAHY 5 5/8 01/15/31	NR	0,15%	NA
Obligation	ENELIM 3 3/8 07/23/28	13	0,45%	Oui
Obligation	ENELIM 3 7/8 01/23/35	13	0,38%	Oui
Obligation	NYLIFE 3.45 01/30/31	10,8	1,14%	Oui
Obligation	ADRBID 10 02/15/29	10,1	0,23%	Oui
Obligation	BBVASM 4 7/8 02/08/36	12	0,34%	Oui

NR : non renseigné

NA : non applicable



EDMOND DE ROTHSCHILD

Remarques : comme indiqué dans le code de transparence, les notes externes MSCI sont sur une échelle de 0 à 20, 20 étant le risque le plus élevé, les notes internes sont sur une échelle de 0 à 20, 0 étant le risque le plus élevé. Conformément au cahier des charges du label, au minimum 75%/90% du fonds est noté. A noter que cet inventaire ne prend pas en compte les liquidités et les dérivés.

Avertissement. Janvier 2024. Le présent document est émis par Edmond de Rothschild Asset Management (France). Document non contractuel conçu à des fins d'information uniquement. Reproduction ou utilisation de son contenu strictement interdite sans l'autorisation du Groupe Edmond de Rothschild. Les informations figurant dans ce document ne sauraient être assimilées à une offre ou une sollicitation de transaction dans une juridiction dans laquelle ladite offre ou sollicitation serait illégale ou dans laquelle la personne à l'origine de cette offre ou sollicitation n'est pas autorisée à agir. Les informations sur les valeurs ne sauraient être assimilées à une opinion d'Edmond de Rothschild Asset Management (France) sur l'évolution prévisible desdites valeurs et, le cas échéant, sur l'évolution prévisible du prix des instruments financiers qu'elles émettent. Ces informations ne sont pas assimilables à des recommandations d'acheter ou de vendre ces valeurs. La composition du portefeuille est susceptible d'évoluer dans le temps. Ce document ne constitue pas et ne doit pas être interprété comme un conseil en investissement, un conseil fiscal ou juridique, ou une recommandation d'acheter, de vendre ou de continuer à détenir un investissement. EdRAM ne saurait être tenu responsable d'une décision d'investissement ou de désinvestissement prise sur la base de ces informations. L'OPC présenté peut ne pas être autorisé à la commercialisation dans votre pays de résidence. En cas de doute sur votre capacité à souscrire dans un OPC, nous vous invitons à vous rapprocher de votre conseiller habituel. Les données chiffrées, commentaires, projections, et autres éléments figurant dans cette présentation reflètent le sentiment d'EdRAM sur les marchés, leur évolution, compte tenu du contexte économique et des informations possédées à ce jour. Tout investissement comporte des risques spécifiques. Il est recommandé à l'investisseur de s'assurer de l'adéquation de tout investissement à sa situation personnelle en ayant recours le cas échéant à des conseils indépendants. De plus, il devra prendre connaissance du document d'information clé pour l'investisseur (DICI/KIID ou DIC PRIIPS/KID PRIIPS) et/ou tout autre document requis par la réglementation locale remis avant toute souscription et disponible sur le site <http://funds.edram.com> ou gratuitement sur simple demande. « Edmond de Rothschild Asset Management » ou « EdRAM » est le nom commercial des entités de gestion d'actifs du Groupe Edmond de Rothschild.

Edmond de Rothschild Asset Management (France)
47, rue du Faubourg Saint-Honoré
75401 Paris Cedex 08

S.A. à Directoire et Conseil de Surveillance au capital de 11.033.769 euros
Numéro d'agrément AMF GP 04000015 - 332.652.536 R.C.S. PARIS
www.edram.fr