

COVÉA SÉCURITÉ

Société d'Investissement à Capital Variable (SICAV)

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 | 1 730 371 203,57 |
| b) Avoirs bancaires | 244 706 437,67 |
| c) Autres actifs détenus par l'OPC | 209 730 643,50 |
| d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c) | 2 184 808 284,74 |
| e) Passif | -35 115 810,62 |
| f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC) | 2 149 692 474,12 |

* Les montants sont signés

NOMBRE D' ACTIONS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

| Action | Type d'action | Actif net par action | Nombre d'actions en circulation | Valeur nette d'inventaire par action |
|----------------------------|------------------|-------------------------|---------------------------------------|--|
| COVÉA SÉCURITÉ A(C) en EUR | C | 824 675,20 | 2 383,9762 | 345,924 |
| COVEA SECURITE A(D) en EUR | D | 151,22 | 1,0000 | 151,220 |
| COVEA SECURITE G(C) en EUR | C | 2 148 867 647,70 | 9 756 886,4651 | 220,241 |

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. | 80,08 | 78,79 |
| 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. | 0,41 | 0,41 |
| 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. | 9,76 | 9,60 |

* 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 | 1 730 371 203,57 | 80,49 | 79,20 |
| TOTAL | | 1 730 371 203,57 | 80,49 | 79,20 |

* 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 | 50,29 | 49,48 |
| ESPAGNE | 9,44 | 9,28 |
| BELGIQUE | 9,23 | 9,08 |
| ITALIE | 9,20 | 9,05 |
| PAYS-BAS | 1,93 | 1,90 |
| ROYAUME-UNI | 0,41 | 0,41 |
| TOTAL | 80,49 | 79,20 |

* 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 | 9,76 | 9,60 |
| 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 | | |
| 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 | 9,76 | 9,60 |

* 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. | 2 357 704 161,67 | 2 000 913 942,50 |
| 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. | | |
| 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. | 84 858 065,52 | 36 159 438,59 |

DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE

| Action | Montant net unitaire EUR | Crédit d'impôt (1) EUR | Montant brut unitaire (2) EUR |
|--------------------------------|--------------------------|------------------------|-------------------------------|
| Dividendes versés | | | |
| 17/05/2021 COVEA SECURITE A(D) | 0,53 | | 0,53 |
| Dividendes à verser | | | |
| COVEA SECURITE A(D) | | | |

(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 |
|---|--------|---------------------|-----------------------|-------------|
| Obligations et valeurs assimilées | | | | |
| Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé | | | | |
| ESPAGNE | | | | |
| TELE EMI 0.75% 13-04-22 EMTN | EUR | 5 500 000 | 5 557 688,60 | 0,26 |
| TOTAL ESPAGNE | | | 5 557 688,60 | 0,26 |
| FRANCE | | | | |
| AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMEN 0.125% 30-04-22 | EUR | 35 200 000 | 35 400 314,52 | 1,65 |
| AIR LIQUIDE FINANCE 2.125% 15.10.2021 | EUR | 10 900 000 | 11 145 980,15 | 0,52 |
| BOUYGUES 4.5% 09/02/2022 | EUR | 2 000 000 | 2 096 050,27 | 0,10 |
| CADES 4.375%06-251021 EMTN | EUR | 15 000 000 | 15 685 361,30 | 0,73 |
| ENGIE 0.5% 13-03-22 EMTN | EUR | 7 600 000 | 7 642 222,16 | 0,35 |
| LEGRAND SA 3.375% 19/04/2022 EMTN | EUR | 1 000 000 | 1 036 467,47 | 0,05 |
| ORANGE 0.5% 15-01-22 EMTN | EUR | 4 400 000 | 4 430 278,03 | 0,21 |
| RTE EDF 3.875%10-280622 | EUR | 1 000 000 | 1 042 809,66 | 0,05 |
| SCHNEIDER ELECTRIC 2.50% 09/21 | EUR | 5 900 000 | 6 052 570,77 | 0,28 |
| THALES 0.0% 31-05-22 EMTN | EUR | 9 700 000 | 9 733 222,50 | 0,45 |
| UNIO NAT 0.3% 04-11-21 EMTN | EUR | 27 100 000 | 27 234 893,03 | 1,27 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT 5.125% 24/05/22 EMTN | EUR | 4 825 000 | 5 087 436,71 | 0,23 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT 0.672% 30-03-22 | EUR | 11 500 000 | 11 580 507,25 | 0,54 |
| TOTAL FRANCE | | | 138 168 113,82 | 6,43 |
| ITALIE | | | | |
| TRNIM 0 7/8 02/02/22 | EUR | 12 300 000 | 12 437 647,95 | 0,58 |
| TOTAL ITALIE | | | 12 437 647,95 | 0,58 |
| PAYS-BAS | | | | |
| BMW FIN 0.125% 13-07-22 EMTN | EUR | 10 000 000 | 10 069 423,29 | 0,46 |
| GEMALTO 2.125% 23-09-21 | EUR | 13 213 000 | 13 456 288,44 | 0,63 |
| LINDE FINANCE BV 0.25% 18-01-22 | EUR | 6 500 000 | 6 531 558,39 | 0,31 |
| RED ELECTRICA FINANCIACIO 3.875% 25/01/2022 | EUR | 10 000 000 | 10 410 739,73 | 0,48 |
| TENNET HOLDING 4.25% 2022 | EUR | 1 000 000 | 1 047 865,14 | 0,05 |
| TOTAL PAYS-BAS | | | 41 515 874,99 | 1,93 |
| ROYAUME-UNI | | | | |
| VOD 1 1/4 08/25/21 | EUR | 1 800 000 | 1 823 914,23 | 0,08 |
| VODAFONE GROUP 0.375% 22-11-21 | EUR | 7 000 000 | 7 039 205,75 | 0,33 |
| TOTAL ROYAUME-UNI | | | 8 863 119,98 | 0,41 |
| TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé | | | 206 542 445,34 | 9,61 |
| TOTAL Obligations et valeurs assimilées | | | 206 542 445,34 | 9,61 |
| Titres de créances | | | | |
| Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé | | | | |
| BELGIQUE | | | | |
| BELGIUM TREASURY BILL 090921 FIX 0.0 | EUR | 70 000 000 | 70 086 946,75 | 3,25 |
| BELG TREA BILL ZCP 10-03-22 | EUR | 40 000 000 | 40 181 419,11 | 1,87 |

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

| Désignation des valeurs | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle | % Actif Net |
|---|--------|---------------------|-------------------------|--------------|
| BELG TREA BILL ZCP 11-11-21 | EUR | 20 000 000 | 20 047 772,18 | 0,93 |
| BELG TREA BILL ZCP 15-07-21 | EUR | 68 000 000 | 68 017 404,90 | 3,17 |
| TOTAL BELGIQUE | | | 198 333 542,94 | 9,22 |
| ESPAGNE | | | | |
| SPAI LETR DEL TESO ZCP 08-10-21 | EUR | 60 000 000 | 60 099 163,62 | 2,80 |
| SPAI LETR DEL TESO ZCP 09-07-21 | EUR | 45 000 000 | 45 006 430,92 | 2,09 |
| SPAI LETR DEL TESO ZCP 11-02-22 | EUR | 36 000 000 | 36 126 895,72 | 1,68 |
| SPAI LETR DEL TESO ZCP 13-08-21 | EUR | 56 000 000 | 56 040 698,00 | 2,61 |
| TOTAL ESPAGNE | | | 197 273 188,26 | 9,18 |
| FRANCE | | | | |
| FRAN TREA BILL BTF ZCP 07-07-21 | EUR | 60 000 000 | 60 006 840,78 | 2,79 |
| FRAN TREA BILL BTF ZCP 22-09-21 | EUR | 60 000 000 | 60 089 912,87 | 2,79 |
| FRAN TREA BILL BTF ZCP 28-07-21 | EUR | 60 000 000 | 60 029 579,58 | 2,79 |
| FRENCH REP ZCP 01-09-21 | EUR | 70 000 000 | 70 078 932,24 | 3,26 |
| FRENCH REP ZCP 06-10-21 | EUR | 50 000 000 | 50 087 858,28 | 2,33 |
| FRENCH REP ZCP 08-09-21 | EUR | 75 000 000 | 75 095 139,28 | 3,50 |
| FRENCH REP ZCP 11-08-21 | EUR | 60 000 000 | 60 043 696,80 | 2,79 |
| FRENCH REP ZCP 14-07-21 | EUR | 50 000 000 | 50 011 648,55 | 2,33 |
| FRENCH REP ZCP 15-09-21 | EUR | 65 000 000 | 65 088 216,23 | 3,03 |
| FRENCH REP ZCP 17-11-21 | EUR | 60 000 000 | 60 148 866,77 | 2,80 |
| FRENCH REP ZCP 18-08-21 | EUR | 65 000 000 | 65 055 774,48 | 3,02 |
| FRENCH REP ZCP 21-04-22 | EUR | 45 000 000 | 45 237 178,53 | 2,11 |
| FRENCH REP ZCP 21-07-21 | EUR | 60 000 000 | 60 021 774,57 | 2,79 |
| FRENCH REP ZCP 23-03-22 | EUR | 45 000 000 | 45 216 013,22 | 2,11 |
| FRENCH REP ZCP 25-08-21 | EUR | 70 000 000 | 70 069 154,36 | 3,26 |
| FRENCH REP ZCP 29-09-21 | EUR | 30 000 000 | 30 048 076,92 | 1,40 |
| UNIO NAT INTE 0.125% 25-05-22 | EUR | 16 400 000 | 16 498 674,08 | 0,76 |
| TOTAL FRANCE | | | 942 827 337,54 | 43,86 |
| ITALIE | | | | |
| ITAL BUON ORDI DEL ZCP 14-07-21 | EUR | 15 000 000 | 15 003 331,99 | 0,69 |
| ITAL BUON ORDI DEL ZCP 30-07-21 | EUR | 40 000 000 | 40 018 020,34 | 1,86 |
| ITAL BUON ORDI DEL ZCP 30-09-21 | EUR | 20 000 000 | 20 028 908,95 | 0,94 |
| ITAL BUON ORDI DEL ZCP 31-08-21 | EUR | 38 000 000 | 38 035 188,89 | 1,77 |
| ITALY BUONI TES BOT ZCP 130522 | EUR | 45 000 000 | 45 210 727,20 | 2,10 |
| ITALY BUONI TES BOT ZCP 140222 | EUR | 27 000 000 | 27 098 512,12 | 1,26 |
| TOTAL ITALIE | | | 185 394 689,49 | 8,62 |
| TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé | | | 1 523 828 758,23 | 70,88 |
| TOTAL Titres de créances | | | 1 523 828 758,23 | 70,88 |

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

| Désignation des valeurs | Devise | Qté Nbre ou nominal | Valeur actuelle | % Actif Net |
|--|--------|---------------------|-------------------------|---------------|
| Organismes de placement collectif | | | | |
| OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays | | | | |
| FRANCE | | | | |
| AMUNDI EURO LIQUIDITY SRI IC | EUR | 128 | 29 658 706,94 | 1,38 |
| BNPP INVEST 3 MOIS | EUR | 88 | 51 141 083,05 | 2,38 |
| BNPP MONEY 3M IC | EUR | 1 860 | 42 781 438,90 | 1,99 |
| CM CIC CASH PART C | EUR | 83 | 42 019 414,83 | 1,96 |
| OSTRUM SRI MONEY PLUS IC | EUR | 430 | 44 127 795,40 | 2,05 |
| TOTAL FRANCE | | | 209 728 439,12 | 9,76 |
| TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays | | | 209 728 439,12 | 9,76 |
| TOTAL Organismes de placement collectif | | | 209 728 439,12 | 9,76 |
| Créances | | | 2 204,38 | |
| Dettes | | | -35 115 810,62 | -1,63 |
| Comptes financiers | | | 244 706 437,67 | 11,38 |
| Actif net | | | 2 149 692 474,12 | 100,00 |