

## **ATTESTATION DE LA COMPOSITION DE L'ACTIF au 26 Juin 2018**

### **SICAV ELISE**

Société d'Investissement à Capital Variable

CIC : 6, avenue de Provence  
75009 - PARIS  
Etablissement Dépositaire



## Attestation de la composition de l'actif au 26 Juin 2018

Mesdames,

Messieurs,

En notre qualité de Commissaire aux Comptes de la SICAV ELISE, et en exécution des dispositions prévues par l'article L.214-8 du Code monétaire et financier et par l'article 38 VI de l'instruction n° 2005-01 de l'AMF prise en application du Règlement général de l'AMF, nous avons vérifié la sincérité de la composition de l'actif telle qu'elle est jointe à la présente attestation.

La composition de l'actif a été établie sous la responsabilité du Président. Il nous appartient, sur la base de nos vérifications, d'en attester la sincérité.

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 ont consisté à vérifier la concordance des informations qui nous ont été données avec les documents de base dont elles sont issues.

Nous n'avons pas d'observation à formuler sur la sincérité des informations données dans les documents joints.

Fait à Paris, le 31 Août 2018

Le Commissaire aux Comptes

JPA



Pascal ROBERT

# **ELISE**

**DOCUMENT D'INFORMATION PERIODICITE SEMESTRIELLE AU 26/06/2018**

## **FORME JURIDIQUE DE L'OPC**

SICAV Générale

## **CLASSIFICATION**

Fonds mixtes (ex Diversifiés)

## **AFFECTATION DES RESULTATS**

Résultat Optionnel

**JPA**

## ETAT DU PATRIMOINE

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Les titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L.214-24-55 du code monétaire et financier	18 785 897,85
b) Avoirs bancaires	2 691 091,44
c) Autres actifs détenus par le FIA	6 976 790,93
d) Total des actifs détenus par le FIA	28 453 780,22
e) Passif	-50 133,29
f) Valeur nette d'inventaire	28 403 646,93

\* Les montants sont signés

**JPA**

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

<b>Part</b>	<b>Type de part</b>	<b>Actif net par part</b>	<b>Nombre de parts en circulation</b>	<b>Valeur liquidative</b>
D ELISE SI.	Distribuable	28 403 646,93	141 814,00	200,28

**JPA**

## MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE

<b>Mouvements intervenus au cours de la période</b>	<b>Mouvements (en montant)</b>
Acquisitions	7 233 971,74
Cessions	8 290 080,81

**JPA**

## DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE

	Part	Montant unitaire en EUR			
		Quote-part du résultat	Quote-part des plus-values nettes	Total unitaire	Crédit d'impôt
<b>Dividendes versés</b>					
	D PART DIST D	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Dividendes à verser</b>					
	D PART DIST D	0,00	0,00	0,00	0,00

**JPA**

## PORTEFEUILLE TITRES DETAILLE

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
<b>TOTAL Actions &amp; valeurs assimilées</b>						<b>7 082 276,95</b>	<b>24,93</b>
TOTAL Actions & valeurs assimilées nég. sur un marché régl. ou assimilé						7 082 276,95	24,93
TOTAL Actions & valeurs ass. nég. sur un marché régl. ou ass.(sauf Warrants et Bons de Sous.)						7 082 276,95	24,93
TOTAL BELGIQUE						<b>335 000,00</b>	<b>1,18</b>
BE0974293251 ANHEUSER-BUSCH INBEV			EUR	4 000		335 000,00	1,18
<b>TOTAL FRANCE</b>						<b>6 419 690,30</b>	<b>22,60</b>
FR0000120172 CARREFOUR			EUR	25 200		360 486,00	1,27
FR0000120628 AXA			EUR	32 000		672 960,00	2,37
FR0000121204 WENDEL			EUR	4 100		494 050,00	1,74
FR0000121667 ESSILOR INTL			EUR	2 600		309 270,00	1,09
FR0000125007 SAINT-GOBAIN			EUR	12 500		476 187,50	1,68
FR0000125338 CAPGEMINI			EUR	5 800		654 240,00	2,30
FR0000125486 VINCI			EUR	5 700		470 820,00	1,66
FR0000127771 VIVENDI			EUR	35 000		738 500,00	2,59
FR0000184798 ORPEA			EUR	3 600		415 260,00	1,46
FR0004035913 ILJAD			EUR	5 200		692 900,00	2,44
FR0004191674 DIRECT ENERGIE			EUR	12 800		538 624,00	1,90
FR0011476928 FNAC DARTY			EUR	3 301		273 322,80	0,96
FR0012435121 ELIS			EUR	16 500		323 070,00	1,14
<b>TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE</b>						<b>327 586,65</b>	<b>1,15</b>
US09253UI088 BLACKSTONE GROUP COMMON UNIT			USD	12 000		327 586,65	1,15
<b>TOTAL Obligations &amp; Valeurs assimilées</b>						<b>11 703 620,90</b>	<b>41,21</b>
TOTAL Obligations & valeurs assimilées nég. sur un marché régl. ou assimilé						10 860 548,85	38,24
TOTAL Obligations à taux fixe nég. sur un marché régl. ou assimilé						3 932 751,15	13,85
<b>TOTAL FRANCE</b>						<b>2 930 845,90</b>	<b>10,32</b>
FR0011302793 VALLOUREC 3,25%12-020819		03/08/2012	EUR	3	3,25	316 390,07	1,11

**JPA**



Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
FR0011337872 RALLYE 5%12-151018 EMTN	15/10/2012	15/10/2018	EUR	5	5,00	513 684,25	1,81
FR0011439900 TEREOS FIN.GRPE 4,25%13-040320	04/03/2013	04/03/2020	EUR	5	4,25	513 203,42	1,82
FR0011801596 RALLYE 4%14-020421 EMTN	02/04/2014	02/04/2021	EUR	3	4,00	238 255,27	0,84
FR0011993120 NEOPOST 2,50%14-230621	23/06/2014	23/06/2021	EUR	3	2,50	307 722,74	1,08
FR0013065372 ILIAD 2,125%15-051222	03/12/2015	05/12/2022	EUR	1	2,125	104 288,49	0,37
FR0013287273 ILIAD 1,5%17-141024	12/10/2017	14/10/2024	EUR	2	1,50	195 278,77	0,69
FR0013318094 ELIS 1,875%18-150223	15/02/2018	15/02/2023	EUR	2	1,875	200 126,44	0,70
XS0210434782 AXA TV05-PERP. EMTN	25/01/2005	31/12/2050	EUR	220	3,00	228 333,74	0,80
XS1384278203 FAURECIA 3,625%16-150623	01/04/2016	15/06/2023	EUR	300	3,625	313 562,71	1,10
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>						<b>1 001 905,25</b>	<b>3,53</b>
XS0906946008 GAZ CAPITAL 3,389%13-200320	21/03/2013	20/03/2020	EUR	300	3,389	314 020,48	1,11
XS1048518358 ARCELORMITTAL 3%14-250319	25/03/2014	25/03/2019	EUR	250	3,00	257 489,55	0,91
XS1382387170 HLD EUROPE 5,65%16-310321	31/03/2016	31/03/2021	EUR	4	5,65	430 395,22	1,51
<b>TOTAL Obligations à taux variable, révisable nég. sur un marché régl. ou assimilé</b>						<b>1 252 648,18</b>	<b>4,41</b>
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>						<b>515 430,00</b>	<b>1,81</b>
FR0013280633 COMMERZBANK TV17-20 IDX	05/09/2017	03/09/2020	EUR	540		515 430,00	1,81
<b>TOTAL FRANCE</b>						<b>334 234,18</b>	<b>1,18</b>
XS0212581564 B.F.C.M. TV05 PERP. EMTN	25/02/2005	31/12/2050	EUR	420		334 234,18	1,18
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>						<b>402 984,00</b>	<b>1,42</b>
FR0013270238 BNP ST.GOBAIN 3%0720 EMTN INDX	27/07/2017	27/07/2020	EUR	435		402 984,00	1,42
<b>TOTAL Obligations indexées nég. sur un marché régl. ou assimilé</b>						<b>4 476 326,95</b>	<b>15,76</b>
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>						<b>838 761,00</b>	<b>2,95</b>
FR0013263134 COMMERZBANK ORA 3,7%17-240620	23/06/2017	24/06/2020	EUR	650	3,70	650 975,00	2,29
XS1211417362 ADLER 4,75%15-080420 RATING	08/04/2015	08/04/2020	EUR	180	4,75	187 786,00	0,66
<b>TOTAL FRANCE</b>						<b>1 339 021,53</b>	<b>4,72</b>
FR0011301480 CASINO GU.3,157%12-060819 EMTN	03/08/2012	06/08/2019	EUR	1	4,407	107 781,12	0,38
FR0013334117 HSBC TV18-170521 SUEZ	23/05/2018	17/05/2021	EUR	300		294 994,41	1,04
FR9347FS3265 CRE.AG.CIB FL TV17-071220 EM.I	06/12/2017	07/12/2020	EUR	600		603 540,00	2,13

**JPA**

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
FR9347FS3414 CRE.AG.CIB TV18-250121 EMT.INX	30/01/2018	25/01/2021	EUR	330		332 706,00	1,17
<b>TOTAL ROYAUME UNI</b>						<b>682 670,36</b>	<b>2,40</b>
FR0013327772 HSBC BANK TV18-040423 AXA	11/04/2018	04/04/2023	EUR	400		402 558,36	1,41
FR0013330248 MOR STAN & CO TV18-21 VIVENDI	26/04/2018	19/04/2021	EUR	280		280 112,00	0,99
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>						<b>848 582,06</b>	<b>2,99</b>
FR0013311172 NATIXIS STR ISS TV18-21 IDX	26/01/2018	19/01/2021	EUR	580		548 320,98	1,93
FR0013317880 NATIXIS STR ISS TV18-21 IDX	19/02/2018	15/02/2021	EUR	302		300 261,08	1,06
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>						<b>767 292,00</b>	<b>2,70</b>
FR0013291671 BNP PARIBAS ISS.TV271020 INDX	26/10/2017	27/10/2020	EUR	400		404 520,00	1,42
FR0013317476 BNP PARIBAS ISS TV18-21 IDX	20/02/2018	22/02/2021	EUR	360		362 772,00	1,28
<b>TOTAL Titres subordonnés (TSR - TSDI)</b>						<b>1 198 822,57</b>	<b>4,22</b>
<b>TOTAL FRANCE</b>						<b>1 198 822,57</b>	<b>4,22</b>
FR0010167247 CNP ASSUR.TV05-PERP.TR.A TSDI	23/02/2005	31/12/2050	EUR	290		292 811,06	1,03
FR0011896513 GROUPAMA TV14-PERPETUAL	28/05/2014	31/12/2050	EUR	8		906 011,51	3,19
<b>TOTAL Oblig &amp; valeurs ass. non négo. sur un marché régi. ou assimilé</b>						<b>843 072,05</b>	<b>2,97</b>
<b>TOTAL Oblig &amp; valeurs ass. non négo. sur un marché régi. ou assimilé</b>						<b>843 072,05</b>	<b>2,97</b>
<b>TOTAL FRANCE</b>						<b>452 552,05</b>	<b>1,60</b>
1145373 MOZAIC CRECHIMMO 9%05122018	05/12/2017	05/12/2018	EUR	4 500	9,00	452 552,05	1,60
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>						<b>390 520,00</b>	<b>1,37</b>
FR0013342631 BNP ISS BV TV18-220621 EMTN	20/06/2018	22/06/2021	EUR	400		390 520,00	1,37
<b>TOTAL Titres d'OPC</b>						<b>6 859 103,33</b>	<b>24,15</b>
<b>TOTAL OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'UE</b>						<b>6 859 103,33</b>	<b>24,15</b>
<b>TOTAL FRANCE</b>						<b>6 859 103,33</b>	<b>24,15</b>
FR0000979825 UNION CASH FCP 3DEC			EUR	2,942		1 503 796,42	5,29
FR0007004171 MCA GESTOBLIG FCP			EUR	13 600		2 395 640,00	8,44
FR0007085121 UNION TAUX VARIABLE FCP 3DEC			EUR	986,241		1 793 755,41	6,32
FR0011668011 MCA ENTREPREND.PME C FCP 3DEC			EUR	650		1 165 911,50	4,10
<b>TOTAL Contrats financiers</b>						<b>78 054,60</b>	<b>0,27</b>

**JPA**

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
<b>TOTAL Engagements à terme conditionnels</b>						<b>78 054,60</b>	<b>0,27</b>
<b>TOTAL Engagements à terme conditionnels sur marché réglementé</b>						<b>78 054,60</b>	<b>0,27</b>
CP1XN8C00002 CPI/0718/CALL/118.	EUR			-14		-574,00	0,00
CP1XN8C00003 CPI/0718/CALL/116.	EUR			-27		-2 241,00	-0,01
PXAXN8F000025 PXA/0718/PUT /5,350.	EUR			-20		-23 006,00	-0,08
PXAXU8F000032 PXA/0918/PUT /5,500.	EUR			39		106 095,60	0,37
TO1XN8F00003 TO1/0718/PUT /50.	EUR			-60		-2 220,00	-0,01

## RÈGLEMENT SFTR

Cet OPC n'est pas intervenu sur des opérations soumises au Règlement UE 2015/2365 relatif à la transparence des opérations de financement sur titres et de la réutilisation (« Règlement SFTR ») au cours de la période et n'a donc pas d'information à communiquer aux investisseurs à ce titre.

**JPA**