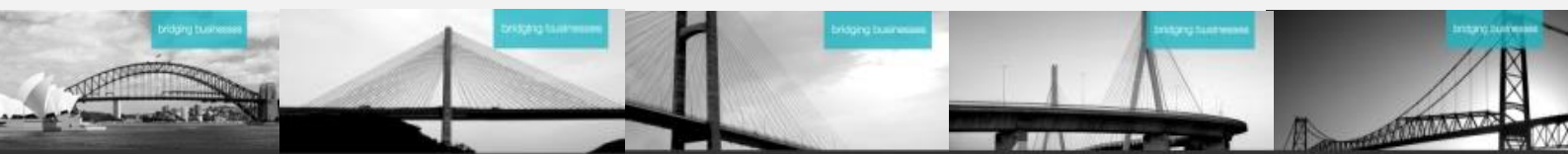


## **ATTESTATION DE LA COMPOSITION DE L'ACTIF au 25 juin 2019**

### **SICAV ELISE**

Société d'Investissement à Capital Variable

CIC : 6 avenue de Provence  
75009 PARIS  
Établissement Dépositaire



## Attestation de la composition de l'actif au 25 juin 2019

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 30 août 2019

Le Commissaire aux comptes

JPA



Pascal ROBERT

# **ELISE**

**DOCUMENT D'INFORMATION PERIODICITE SEMESTRIELLE AU 25/06/2019**

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

SICAV Générale

## **CLASSIFICATION**

Classification BCE Fonds mixtes (ex Diversifiés)

## **AFFECTATION DES RESULTATS**

Résultat Optionnel

## 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	18 805 806,22
b) Avoirs bancaires	3 274 535,73
c) Autres actifs détenus par le FIA	6 903 522,20
d) Total des actifs détenus par le FIA	28 983 864,15
e) Passif	-37 782,00
f) Valeur nette d'inventaire	28 946 082,15

\* Les montants sont signés

**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</b>	<b>Nombre de parts en circulation</b>	<b>Valeur liquidative</b>
D ELISE SI.	Distribuable	28 946 082,15	146 486,00	197,60

## MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	5 765 476,77
Cessions	7 331 043,29

## 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

## 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>7 031 785,01</b>	<b>24,29</b>
<b>TOTAL Actions &amp; valeurs assimilées négo. sur un marché régl. ou assimilé</b>						<b>7 031 785,01</b>	<b>24,29</b>
<b>TOTAL Actions &amp; valeurs ass. nég. sur un marché régl. ou ass.(sauf Warrants et Bons de Sous.)</b>						<b>7 031 785,01</b>	<b>24,29</b>
<b>TOTAL FRANCE</b>						<b>6 662 433,44</b>	<b>23,01</b>
FR0000120271 TOTAL			EUR	14 300		699 913,50	2,42
FR0000120628 AXA			EUR	31 000		716 720,00	2,48
FR0000121204 WENDEL			EUR	4 100		487 490,00	1,68
FR0000121261 MICHELIN			EUR	2 700		297 675,00	1,03
FR0000121485 KERING			EUR	400		204 240,00	0,71
FR0000125007 SAINT-GOBAIN			EUR	14 000		474 600,00	1,64
FR0000125338 CAPGEMINI			EUR	6 400		719 680,00	2,49
FR0000125486 VINCI			EUR	5 700		524 742,00	1,81
FR0000127771 VIVENDI			EUR	20 000		495 600,00	1,71
FR0000130692 CHARGEURS			EUR	15 137		266 713,94	0,92
FR0000184798 ORPEA			EUR	4 600		471 960,00	1,63
FR0004035913 ILIAD			EUR	3 900		374 634,00	1,29
FR0011476928 FNAC DARTY			EUR	4 300		273 265,00	0,94
FR0012435121 ELIS			EUR	22 500		351 450,00	1,21
FR0013214145 SMCP			EUR	22 500		303 750,00	1,05
<b>TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE</b>						<b>369 351,57</b>	<b>1,28</b>
US09253U1088 BLACKSTONE GROUP COMMON UNIT			USD	9 500		369 351,57	1,28
<b>TOTAL Obligations &amp; Valeurs assimilées</b>						<b>11 774 021,21</b>	<b>40,68</b>
<b>TOTAL Obligations &amp; valeurs assimilées négo. sur un marché régl. ou assimilé</b>						<b>11 539 521,21</b>	<b>39,87</b>
<b>TOTAL Obligations à taux fixe négo. sur un marché régl. ou assimilé</b>						<b>3 887 212,99</b>	<b>13,43</b>
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>						<b>405 523,93</b>	<b>1,40</b>
XS1843441491 ADLER REAL ESTATE 1,5%19-0422	17/04/2019	17/04/2022	EUR	4	1,50	405 523,93	1,40
<b>TOTAL FRANCE</b>						<b>3 056 108,62</b>	<b>10,56</b>



Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
FR0011302793 VALLOUREC 3,25%12-020819	03/08/2012	02/08/2019	EUR	3	3,25	309 568,36	1,07
FR0011439900 TEREOS FIN.GRPE 4,25% 13-040320	04/03/2013	04/03/2020	EUR	5	4,25	252 913,46	0,87
FR0011801596 RALLYE 4% 14-020421 EMTN	02/04/2014	02/04/2021	EUR	1	4,00	17 500,00	0,06
FR0011993120 NEOPOST 2,50%14-230621	23/06/2014	23/06/2021	EUR	3	2,50	307 581,97	1,06
FR0012872174 BOLLORE 2,875%15-290721	29/07/2015	29/07/2021	EUR	4	2,875	425 191,78	1,48
FR0013065372 ILIAD 2,125% 15-051222	03/12/2015	05/12/2022	EUR	1	2,125	105 027,67	0,36
FR0013260379 CASINO GUICHARD PE 1,865%17-22	13/06/2017	13/06/2022	EUR	4	1,865	326 305,36	1,13
FR0013287273 ILIAD 1,5%17-141024	12/10/2017	14/10/2024	EUR	2	1,50	196 764,11	0,68
FR0013318094 ELIS 1,875%18-150223	15/02/2018	15/02/2023	EUR	2	1,875	211 406,16	0,73
FR0013331188 ILIAD 0,625% 18-251121	25/04/2018	25/11/2021	EUR	2	0,625	200 222,00	0,69
XS1384278203 FAURECIA 3,625%16-150623	01/04/2016	15/06/2023	EUR	300	3,625	307 052,50	1,06
XS1590066624 LOXAM 4,25%17-150424	04/04/2017	15/04/2024	EUR	370	4,25	396 575,25	1,37
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>						<b>425 580,44</b>	<b>1,47</b>
XS1382387170 HLD EUROPE 5,65% 16-310321	31/03/2016	31/03/2021	EUR	4	5,65	425 580,44	1,47
<b>TOTAL Obligations à taux variable, révisable négo. sur un marché régl. ou assimilé</b>						<b>883 503,50</b>	<b>3,05</b>
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>						<b>496 832,00</b>	<b>1,71</b>
FR0013280633 COMMERZBANK TV17-20 IDX	05/09/2017	03/09/2020	EUR	640		496 832,00	1,71
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>						<b>386 671,50</b>	<b>1,34</b>
FR0013270238 BNP ST.GOBAIN 3%0720 EMTN INDX	27/07/2017	27/07/2020	EUR	435		386 671,50	1,34
<b>TOTAL Obligations indexées négo. sur un marché régl. ou assimilé</b>						<b>3 971 427,99</b>	<b>13,73</b>
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>						<b>965 940,00</b>	<b>3,34</b>
FR0013263134 COMMERZBANK ORA 3,7%17-240620	23/06/2017	24/06/2020	EUR	840	3,70	842 436,00	2,91
FR0013291192 COMMERZBANK TV17-1020 RENAULT	24/10/2017	22/10/2020	EUR	160		123 504,00	0,43
<b>TOTAL FRANCE</b>						<b>981 906,28</b>	<b>3,39</b>
FR0011301480 CASINO GU.3,157%12-060819 EMTN	03/08/2012	06/08/2019	EUR	1	4,407	102 669,04	0,35
FR0013351137 HSBC TV18-190721 MICHELIN R	26/07/2018	19/07/2021	EUR	580		588 144,24	2,03
FR9347FS4487 CA CIB FS TV18-21 PUBLICIS GRP	26/07/2018	26/07/2021	EUR	330		291 093,00	1,01
<b>TOTAL ROYAUME UNI</b>						<b>444 400,00</b>	<b>1,54</b>
FR0013420213 MOR STAN & CO TV19-0524 TOTAL	23/05/2019	16/05/2024	EUR	440		444 400,00	1,54
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>						<b>542 251,71</b>	<b>1,87</b>

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
FR0013311172 NATIXIS STR ISS TV18-21 IDX	26/01/2018	19/01/2021	EUR	630		542 251,71	1,87
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>						<b>1 036 930,00</b>	<b>3,59</b>
FR0013342631 BNP ISS BV TV18-220621 EMTN	20/06/2018	22/06/2021	EUR	400		212 800,00	0,74
FR0013413820 BNP PARIBAS ISS TV19-24 IDX	16/04/2019	16/04/2024	EUR	450		388 440,00	1,34
FR0013418084 BNPP TV19-090522 EMTN INDEX	09/05/2019	09/05/2022	EUR	450		435 690,00	1,51
<b>TOTAL Titres subordonnés (TSR - TSDI)</b>						<b>2 797 376,73</b>	<b>9,66</b>
<b>TOTAL FRANCE</b>						<b>2 797 376,73</b>	<b>9,66</b>
FR0000572646 BNP PARIBAS TMO OCT85 TSDI	16/09/1985	31/12/2050	EUR	435 909		256 376,18	0,89
FR0010167247 CNP ASSUR.TV05-PERP.TR.A TSDI	23/02/2005	31/12/2050	EUR	310		313 187,43	1,08
FR0010815464 GROUPAMA 7,875%09-271039	27/10/2009	27/10/2039	EUR	2		107 892,81	0,37
FR0010905158 RADIAN 4,55%10-280620 TSR	08/06/2010	28/06/2020	EUR	18 000	4,55	19 617,76	0,07
FR0011896513 GROUPAMA TV14-PERPETUAL	28/05/2014	31/12/2050	EUR	8		934 020,33	3,22
XS0207764712 B.F.C.M. TV04-PERP. EMTN	15/12/2004	31/12/2050	EUR	400		260 929,07	0,90
XS0210434782 AXA TV05-PERP. EMTN	25/01/2005	31/12/2050	EUR	220	3,00	227 372,31	0,79
XS0212581564 B.F.C.M. TV05 PERP. EMTN	25/02/2005	31/12/2050	EUR	420		275 825,81	0,95
XS1155697243 LA MONDIALE TV14-PERP SUBORD.	17/12/2014	31/12/2050	EUR	350		402 155,03	1,39
<b>TOTAL Oblig &amp; valeurs ass. non négo. sur un marché régl. ou assimilé</b>						<b>234 500,00</b>	<b>0,81</b>
<b>TOTAL Oblig &amp; valeurs ass. non négo. sur un marché régl. ou assimilé</b>						<b>234 500,00</b>	<b>0,81</b>
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>						<b>234 500,00</b>	<b>0,81</b>
FR0013270170 BNP ST.GOBAIN 2%0720 EMTN INDX	27/07/2017	27/07/2020	EUR	250		234 500,00	0,81
<b>TOTAL Titres d'OPC</b>						<b>6 866 138,65</b>	<b>23,72</b>
<b>TOTAL OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'UE</b>						<b>6 866 138,65</b>	<b>23,72</b>
<b>TOTAL FRANCE</b>						<b>6 866 138,65</b>	<b>23,72</b>
FR0000979825 CM CIC CASH IC FCP 3DEC			EUR	6,858		3 495 887,65	12,07
FR0007004171 MCA GESTOBLIG FCP			EUR	13 600		2 390 064,00	8,26
FR0011668011 MCA ENTREPREND.PME C FCP 3DEC			EUR	650		980 187,00	3,39
<b>TOTAL Contrats financiers</b>						<b>-14 670,00</b>	<b>-0,05</b>
<b>TOTAL Engagements à terme conditionnels</b>						<b>-14 670,00</b>	<b>-0,05</b>
<b>TOTAL Engagements à terme conditionnels sur marché réglementé</b>						<b>-14 670,00</b>	<b>-0,05</b>

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Taux	Valeur boursière	% Actif Net
CP1XN9C00002 CP1/0719/CALL/116.			EUR	-16		-2 848,00	-0,01
DG1XN9C00003 DG1/0719/CALL/90.			EUR	-17		-5 117,00	-0,02
EF1XN9P00001 EF1/0719/PUT /106.			EUR	-30		-2 220,00	-0,01
KR1XN9C00002 KR1/0719/CALL/520.			EUR	-1		-852,00	0,00
ML1XN9C00001 ML1/0719/CALL/110.			EUR	-9		-2 763,00	-0,01
TO1XN9P00004 TO1/0719/PUT /47.			EUR	-30		-870,00	0,00

## 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.