

ATTESTATION DE LA COMPOSITION DE L'ACTIF au 25 juin 2024

SICAV ELISE

Société d'Investissement à Capital Variable

CREDIT INDUSTRIEL ET COMMERCIAL (CIC)

6 avenue de Provence

75009 PARIS

Établissement Dépositaire



Attestation de la composition de l'actif au 25 juin 2024

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 26 août 2024

Le Commissaire aux comptes

JPA



Pascal ROBERT

ELISE

Document d'information périodique au 25/06/2024

Sommaire

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR	3
NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART OU ACTION	4
ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR	5
MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR	6
DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE	7
COMMISSION DE PERFORMANCE	8
INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)	9
OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE	12
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS	13
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS	14
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE	15
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT	16
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS	17
OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	18
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	19
SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE	20

ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR

Éléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-24-55 du code monétaire et financier	17.988.606,52
b) Avoirs bancaires	158.372,11
c) Autres actifs détenus par le FIA	7.269.797,84
d) Total des actifs détenus par le FIA	25.416.776,47
e) Passif	-61.425,60
f) Valeur nette d'inventaire	25.355.350,87

SP
A

ELISE

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

Code ISIN de la part	Libellé de la part	Affectation des sommes distribuables	Devise de la part	Actif net de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
FR0000174294	PART DIST R	Distribuable	EUR	25.355.350,87	109.703	231,12

SP
A

ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR

Eléments du portefeuille titres :	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Titres financiers négociés sur un marché européen	69,59	69,42
b) Titres financiers négociés sur un marché non européen	0,00	0,00
c) Titres financiers nouvellement émis	0,00	0,00
d) Autres actifs	29,61	29,54

SP
A

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

Eléments du portefeuille titres :	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
a) Titres financiers négociés sur un marché européen	3.659.716,87	6.225.593,39
b) Titres financiers négociés sur un marché non européen	0,00	0,00
c) Titres financiers nouvellement émis	0,00	0,00
d) Autres actifs	3.746.066,37	5.011.537,66

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	7.405.783,24
Cessions	11.237.131,05

SP
A

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Pas de distribution sur la période.

SP
A

COMMISSION DE PERFORMANCE

PART DIST R	25/06/2024
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance	0,00

SP
A

ELISE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Actions et valeurs assimilées			8.355.603,44	32,96
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			8.026.603,44	31,66
Aérospatial / Défense			269.560,00	1,06
AIRBUS	EUR	2.000	269.560,00	1,06
Assurances multirisques			366.044,00	1,44
AXA	EUR	11.900	366.044,00	1,44
Banques			520.816,00	2,06
BNP PARIBAS ACTIONS A	EUR	8.600	520.816,00	2,06
Chimie			457.930,00	1,81
AIR LIQUIDE	EUR	2.750	457.930,00	1,81
Compagnies pétrolières			565.920,00	2,23
TOTALENERGIES SE	EUR	9.000	565.920,00	2,23
Construction / Matériaux			527.800,00	2,08
VINCI	EUR	5.200	527.800,00	2,08
Electricité			322.943,44	1,27
NEOEN	EUR	8.548	322.943,44	1,27
Electronique / Equipements électriques			1.197.520,00	4,72
ASML HOLDING	EUR	450	427.590,00	1,68
SCHNEIDER ELECTRIC	EUR	3.400	769.930,00	3,04
Gaz eau et autres serv aux collectivités			405.375,00	1,60
VEOLIA ENVIRONNEMENT	EUR	14.100	405.375,00	1,60
Inv immobilier et serv			15.000,00	0,06
ARVERNE GROUP BSA 21	EUR	100.000	15.000,00	0,06
Logiciel / Services informatiques			274.560,00	1,08
DASSAULT SYSTEMES	EUR	7.800	274.560,00	1,08
Média			1.014.138,00	4,00
VIVENDI	EUR	103.000	1.014.138,00	4,00
Produits à usage domestique			1.142.040,00	4,51
LVMH MOET HENNESSY VUITTON	EUR	1.550	1.142.040,00	4,51
SOC PLACEMENT IMMOBILIER			706.800,00	2,79
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD UNIT	EUR	9.500	706.800,00	2,79
Voyage et Loisirs			240.157,00	0,95
ACCOR	EUR	6.100	240.157,00	0,95
Actions et valeurs assimilées non négociées sur un marché réglementé			329.000,00	1,30
Inv immobilier et serv			329.000,00	1,30
ARVERNE GROUP	EUR	50.000	329.000,00	1,30
Obligations			9.633.003,08	37,99
Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			9.633.003,08	37,99
Assurances généralistes			557.069,75	2,20
CNP ASSUR.TV05-PERP.TR.A TSDI	EUR	586	557.069,75	2,20
Assurances multirisques			2.006.463,97	7,91
AXA TV03-PERP EMTN	EUR	200	184.271,39	0,72
AXA TV05-PERP. EMTN	EUR	220	207.454,05	0,82

ELISE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
BNP CARDIF 1%17-291124	EUR	5	496.157,52	1,96
COFACE 5,75%23-281133	EUR	2	220.761,20	0,87
LA MONDIALE TV14-PERP SUBORD.	EUR	875	897.819,81	3,54
Automobiles et équipementiers			264.000,00	1,04
RENAULT TPA 83-84	EUR	800	264.000,00	1,04
Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			407.781,97	1,61
FONCIERE DES ASSOCIES 300626	EUR	410	407.781,97	1,61
Banques			1.868.022,23	7,37
B.F.C.M. TV04-PERP. EMTN	EUR	0,00	0,00	0,00
BANCO SANTANDER TV24-34 EMTN	EUR	2	205.398,22	0,81
BFCM 0,01%21-070325	EUR	2	194.946,14	0,77
BNP PARIBAS TV19-150725 EMTN	EUR	1	100.300,41	0,39
BPCE 3,85%14-250626 TSR	EUR	200.000	199.642,78	0,79
CRED.AGRIC.2,80%15-161025 TSR	EUR	134.816	133.594,36	0,53
CRED.AGRICOLE 3%14-221224 TSR	EUR	265.000	263.584,27	1,04
CREDIT AGR.2,7% 15-150725	EUR	390.000	387.353,79	1,53
CREDIT AGR.2,70%15-140425 TSR	EUR	68.548	68.204,51	0,27
RCI BANQUE 4,625%23-021026	EUR	300	314.997,75	1,24
Commerce de détail			1.183,86	0,01
RALLYE 4,371%17-280232 EMTN	EUR	10	1.049,88	0,01
RALLYE 4%14-280232 EMTN	EUR	1	133,98	0,00
Construction / Matériaux			261.990,00	1,03
SAINT-GOBAIN TPA 83 TR.1	EUR	2.130	261.990,00	1,03
ENERGIE ALTERNATIVE			284.576,82	1,12
AKUO ENERGY 4%19-221125	EUR	50	48.941,26	0,19
AKUO ENERGY 8%23-071228	EUR	224	235.635,56	0,93
Equipements et services de santé			0,00	0,00
ERFFP 2 1/8 07/25/24	EUR	0,00	0,00	0,00
Equip serv/distrib prod pétro			212.925,74	0,84
TECHNIPFMC TV20-300625	EUR	200	212.925,74	0,84
Finance générale			1.433.355,30	5,65
ARVAL SERV LEAS 4,625%23-1224	EUR	2	205.746,83	0,81
HLD EUROPE 3,85%20-230926	EUR	5	497.365,28	1,96
HLD EUROPE 3,85%21-160727	EUR	90	87.039,88	0,34
PEUGEOT INVEST 1,875%19-301026	EUR	2	191.109,26	0,76
ROTHSCHILD TV04-PERP.EMTN	EUR	590	452.094,05	1,78
Immobilier			294.858,30	1,16
LANDEV1 TV21-201025	EUR	330	294.858,30	1,16
Ingénierie Industrielle			203.719,10	0,80
TRATON FIN LUX 4,125%23-180125	EUR	2	203.719,10	0,80
Instr Invest autre que actions			339.966,00	1,34
DUFYR ONE 2,5%17-151024	EUR	340	339.966,00	1,34
Inv immobilier et serv			772.651,72	3,05
6E.SENS.IMMO. 4PCT22 15022025	EUR	18	180.001,03	0,71
CALAF 7%28012021	EUR	300	201.074,25	0,79

ELISE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instrument	Devise	Quantité	Montant	%AN
CAPELLI 7%19-190924 EMTN	EUR	2	188.686,44	0,75
ILIAD 5,125%21-151026	EUR	200	202.890,00	0,80
SOC PLACEMENT IMMOBILIER			472.036,24	1,86
BIRD AM 5,25%19-130624	EUR	22	210.801,64	0,83
EMERAUDEV 6%21-120426	EUR	330	261.234,60	1,03
Transport industriel			252.402,08	1,00
GETLINK 3,5%20-301025	EUR	250	252.402,08	1,00
Parts d'OPC et fonds d'investissements			7.163.757,82	28,25
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne			4.581.008,87	18,07
OPCVM			1.960.695,87	7,73
GROUPAMA AXIOM LEGACY -J	EUR	900	985.626,00	3,89
UNION + (IC)	EUR	4,9	975.069,87	3,84
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne			2.620.313,00	10,34
MCA ENTREPRENDRE PME	EUR	4.700	994.943,00	3,93
MCA FINANCE MCA GTD	EUR	3.900	699.270,00	2,76
MCA GESTOBLIG	EUR	5.000	926.100,00	3,65
Autres OPC et fonds d'investissements			2.582.748,95	10,18
Autres OPC et fonds d'investissements			2.582.748,95	10,18
AMDI STOXX EUROPE 600 ACC	EUR	6.800	1.632.612,00	6,44
AM EURO GOV BD 10-15Y-ETF A	EUR	2.615	504.511,95	1,99
ISHARES CHINA LARGE CAP	USD	6.250	445.625,00	1,75
Total			25.152.364,34	99,20

OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE

Libellé instrument	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)			
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)	
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)
Total	0,00	0,00		0,00		0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

SP
A

ELISE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS

Instruments financiers à terme – actions				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
UL1/1224/CALL/75.	140,00	90.720,00	0,00	591.884,16
UL1/1224/CALL/90.	-140,00	0,00	-26.040,00	-246.618,40
UL1/1224/PUT /65.	-49,00	0,00	-11.564,00	79.337,66
Sous total		90.720,00	-37.604,00	424.603,42
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		90.720,00	-37.604,00	424.603,42

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

ELISE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS

Instruments financiers à terme – taux d'intérêts				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

UBA

ELISE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE

Instruments financiers à terme – de change				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

SP
A

ELISE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT

Instruments financiers à terme – sur risque de crédit				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

SP
A

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS

Instruments financiers à terme – autres expositions				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	0,00	0,00

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

S
P
A

ELISE

OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)

Libellé instrument	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)				Classe de part couverte
	Actif	Passif	Devises à recevoir (+)		Devises à livrer (-)		
			Devise	Montant (*)	Devise	Montant (*)	
Total	0,00	0,00		0,00		0,00	

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

SP
A

ELISE

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)

Libellé instrument	Quantité/ Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)	Classe de part couverte
		Actif	Passif	+/-	
Futures					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Options					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Swaps					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Autres instruments					
Sous total		0,00	0,00	0,00	
Total		0,00	0,00	0,00	

(*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

SP
A

SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	25.152.364,34
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	0,00
Total instruments financiers à terme - actions	53.116,00
Total instruments financiers à terme - taux	0,00
Total instruments financiers à terme - change	0,00
Total instruments financiers à terme - crédit	0,00
Total instruments financiers à terme - autres expositions	0,00
Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises	0,00
Autres actifs (+)	173.692,13
Autres passifs (-)	-23.821,60
Passifs de financement (-)	-
Total = actif net	25.355.350,87