

ATTESTATION DE LA COMPOSITION DE L'ACTIF au 30 juin 2026

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 30 juin 2026

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 28 août 2026

Le Commissaire aux comptes

JPA



Pascal ROBERT

ELISE

Document d'information périodique au 30/06/2026

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
VENTILATION DES AUTRES ACTIFS DU D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE	8
COMMISSION DE PERFORMANCE	9
INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)	10
INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE	13
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS	14
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – TAUX D'INTÉRÊTS	15
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE	16
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – SUR RISQUE DE CRÉDIT	17
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – AUTRES EXPOSITIONS	18
INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE (UTILISÉES EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	19
INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – DE CHANGE (UTILISÉS EN COUVERTURE D'UNE CATÉGORIE DE PART)	20
SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE	21

ÉTAT 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. 214-24-55 du code monétaire et financier	13 634 064,11
b) Avoirs bancaires	235 425,96
c) Autres actifs détenus par le FIA	5 564 915,39
d) Total des actifs détenus par le FIA	19 434 405,46
e) Passif	-222 393,92
f) Valeur nette d'inventaire	19 212 011,54

* Les montants sont signés

SPA

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 en devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative en devise de la part
FR0000174294	PART DIST R	Distribuable	EUR	19 212 011,54	74 572,700	257,62

SPA

ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES EN EUR

Eléments du portefeuille titres :	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Titres financiers négociés sur un marché européen	68,90	68,11
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	30,96	30,61

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	1 720 721,33	2 470 066,77
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	1 390 079,84	1 830 599,53

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	3 110 801,17
Cessions	4 300 666,30

SPA

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Pas de distribution sur la période.

SP
A

VENTILATION DES AUTRES ACTIFS DU D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Parts d'OPC	28,90	28,57
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	21,60	21,35
FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne	0,00	0,00
Autres OPC et fonds d'investissements	7,30	7,22
Autres actifs	2,06	2,04
Total	30,96	30,61

SPA

COMMISSION DE PERFORMANCE

PART DIST R	30/06/2026
Commission de performance (frais variables)	0,00
Pourcentage de commission de performance*	0,00

*Par rapport à l'actif net moyen

SPA

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Actions et valeurs assimilées			6 514 064,12	33,90
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			6 117 064,12	31,84
Aérospatial et défense			593 876,00	3,09
AIRBUS	EUR	1 900	369 626,00	1,92
SAFRAN PROV.ECHANGE	EUR	650	224 250,00	1,17
Articles personnels			483 160,00	2,51
HERMES INTERNATIONAL	EUR	60	95 880,00	0,50
LVMH MOET HENNESSY VUITTON	EUR	800	387 280,00	2,01
Assurance - Non vie			377 110,00	1,96
AXA	EUR	8 600	377 110,00	1,96
Banques			766 050,00	3,99
BNP PARIBAS ACTIONS A	EUR	7 500	766 050,00	3,99
Bâtiment et matériaux de construction			384 164,00	2,00
SAINT-GOBAIN	EUR	3 400	269 144,00	1,40
VINCI	EUR	900	115 020,00	0,60
Boissons			116 316,00	0,61
REMY COINTREAU	EUR	2 700	116 316,00	0,61
Chimie			476 520,00	2,48
AIR LIQUIDE	EUR	2 750	476 520,00	2,48
Equipements et services médicaux			310 382,60	1,62
ESSILORLUXOTTICA	EUR	1 892	310 382,60	1,62
Gaz eau et services multiples aux collectivités			415 416,00	2,16
VEOLIA ENVIRONNEMENT	EUR	11 400	415 416,00	2,16
Instruments de placement hors actions			5 000,00	0,03
ARVERNE GROUP BSA 21	EUR	100 000	5 000,00	0,03
Matériel équipements destinés aux TI			1 315 990,00	6,85
ASML HOLDING	EUR	350	602 490,00	3,14
SCHNEIDER ELECTRIC	EUR	2 500	713 500,00	3,71
Médias			249 828,08	1,30
CANAL+SA	GBP	88 000	249 828,08	1,30
Pharmacie/biotechnologie/Producteurs de Marijuana			180 988,44	0,94
NOVO NORDISK A/S-B	DKK	4 300	180 988,44	0,94
Sociétés de placement immobilier			138 307,50	0,72
UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	EUR	1 350	138 307,50	0,72
Soins personnels pharmacies et épiceries			172 642,50	0,90
L'OREAL	EUR	450	172 642,50	0,90
Transport industriel			131 313,00	0,68
PRADO-CARENAGE(MARSEIL.TUNNEL)	EUR	4 810	131 313,00	0,68
Actions et valeurs assimilées non négociées sur un marché réglementé			397 000,00	2,06
Instruments de placement hors actions			397 000,00	2,06
ARVERNE GROUP	EUR	50 000	397 000,00	2,06
Obligations			7 119 999,99	37,06

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
Autres obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			7 119 999,99	37,06
Assurance vie			499 253,22	2,60
CNP ASSUR.0,375%20-080328 EMTN	EUR	2	191 128,36	1,00
GROUPAMA 3,375%18-240928	EUR	3	308 124,86	1,60
Automobiles et équipementiers			237 965,00	1,24
RENAULT TPA 83-84	EUR	650	237 965,00	1,24
Banques			2 043 743,18	10,64
BANCO SANTANDER TV24-34 EMTN	EUR	5	522 638,01	2,72
BFCM 1 7/8 06/18/29	EUR	5	480 734,59	2,50
BNP PARIBAS 1,625%19-020731	EUR	5	455 025,00	2,37
CR. AGRI.ASSUR. 2%20-170730	EUR	4	384 571,23	2,00
CREDIT AGRICOLE 2%20-280730	EUR	7	99 274,35	0,52
KNFP Float PERP	EUR	140	101 500,00	0,53
Bâtiment et matériaux de construction			70 590,00	0,37
SAINT-GOBAIN TPA 83 TR.1	EUR	543	70 590,00	0,37
Distributeurs			1 189,86	0,00
RALFP 4.371 02/28/32	EUR	10	1 079,87	0,00
RALLYE 4%14-280232 EMTN	EUR	1	109,99	0,00
Energie non renouvelable			377 817,26	1,97
TOTALENERGIES SE TV20-PERP.	EUR	400	377 817,26	1,97
Energies renouvelables			242 605,44	1,26
AKUO ENERGY 8%23-071228	EUR	224	242 605,44	1,26
Fournisseurs de services de télécommunications			197 228,63	1,03
ILDFF 1 7/8 02/11/28	EUR	2	197 228,63	1,03
Investissement immobilier et services			244 297,00	1,27
CAPELLI 7%19-190924 EMTN	EUR	2	0,00	0,00
GRPYNG 7 01/28/26	EUR	300	197 217,00	1,03
REALTE 7 1/2 09/13/26	EUR	22	47 080,00	0,24
Logiciels et services informatiques			189 808,37	0,99
PROSUS 1,288%13072029 EMTN	EUR	200	189 808,37	0,99
Matériel équipements destinés aux TI			409 152,95	2,13
NEXFP 4 1/8 05/29/29	EUR	3	306 102,74	1,59
PRYIM 3 5/8 11/28/28	EUR	100	103 050,21	0,54
Médias			513 225,21	2,67
IPSFP 3 3/4 01/22/30	EUR	1	102 204,11	0,53
MMBFP 4 3/4 06/12/30	EUR	4	411 021,10	2,14
Services appui à industrie			402 038,36	2,09
SPIEFP 3 3/4 05/28/30	EUR	4	402 038,36	2,09
Services bancaires invest et de courtage			455 812,35	2,37
HLDERP 4 1/8 04/02/30	EUR	200	203 716,85	1,06
ROTH Float PERP	EUR	300	252 095,50	1,31
Sociétés de placement immobilier			586 448,85	3,05
ALTAREA 1,75%20-160130	EUR	3	282 662,05	1,47
ARGFP 3.779 10/30/29	EUR	3	303 786,80	1,58

ELISE

INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS ÉLIGIBLES (HORS IFT)

Instruments	Devise	Quantité	Montant	%AN
CAPLFP 6 03/31/31	EUR	330	0,00	0,00
CAPLFP 7 03/31/28	EUR	330	0,00	0,00
Soins personnels pharmacies et épiceries			443 979,73	2,31
ITMENT 5 3/4 07/22/29	EUR	4	443 979,73	2,31
Transport industriel			204 844,58	1,07
GETFP 4 1/8 04/15/30	EUR	200	204 844,58	1,07
Parts d'OPC et fonds d'investissements			5 551 612,31	28,90
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union européenne			4 148 749,81	21,60
AM EURO GOV BD 10-15Y-ETF A	EUR	1 650	336 814,50	1,75
AXIOM SHORT DUR-P1C EUR-ACC	EUR	500	604 565,00	3,15
ISHARES CORE EURO CORP BOND	EUR	1 170	141 125,40	0,74
ISHARES CORE S&P 500	EUR	240	169 195,20	0,88
ISHRS NCL ERG AND URM MG ETF	USD	15 000	79 983,37	0,42
MCA ENTREPRENDRE PME	EUR	3 600	886 248,00	4,61
MCA FINANCE MCA GTD	EUR	5 500	1 055 505,00	5,49
MCA GESTOBLIG	EUR	3 300	623 502,00	3,25
UNION PLUS	EUR	1,2	251 811,34	1,31
Autres OPC et fonds d'investissements			1 402 862,50	7,30
AM CR STX EUROPE 600 ETF ACC	EUR	4 450	1 402 862,50	7,30
Total			19 185 676,42	99,86

INVENTAIRE DES OPÉRATIONS À TERME DE DEVISE

Libellé instrument	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)			
	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.

DRAFT

INSTRUMENTS FINANCIERS À TERME – ACTIONS

Instruments financiers à terme – actions				
Libellé instrument	Quantité/Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)
		Actif	Passif	+/-
Futures				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Options				
BN1/0726/CALL/104.	-15,00	0,00	2 235,00	-59 598,69
Sous total		0,00	2 235,00	-59 598,69
Swaps				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Autres instruments				
Sous total		0,00	0,00	0,00
Total		0,00	2 235,00	-59 598,69

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

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 en Euro (*)
		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

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 en Euro (*)
		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

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 en Euro (*)
		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.

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 en Euro (*)
		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

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

Libellé instrument	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition en Euro (*)				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.

SPA

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 en Euro (*)	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.

SYNTHÈSE DE L'INVENTAIRE

	Valeur actuelle présentée au bilan
Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)	19 185 676,42
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	-2 235,00
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 (+)	248 729,04
Autres passifs (-)	-220 158,92
Total = actif net	19 212 011,54