

TRUSTEAM ROC

DOCUMENT D'INFORMATION PERIODICITE SEMESTRIELLE AU 30/06/2017

FORME JURIDIQUE DE L'OPC

FCP Général

CLASSIFICATION

Actions Internationales

AFFECTATION DES RESULTATS

Résultat capitalisable & distribuable

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. 214-20 du code monétaire et financier	134 948 372,58
b) Avoirs bancaires	6 790 788,60
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	13 703 139,24
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	155 442 300,42
e) Passif	-491 296,43
f) Valeur nette d'inventaire	154 951 003,99

* Les montants sont signés

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

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur liquidative
C1 TRUST.ROC A FCP 3D	Capitalisable	81 691 024,55	204 515,454	399,44
C2 TRUSTEAM ROC B 3D	Capitalisable	68 468 139,99	161 281,247	424,53
D3 TRUSTEAM ROCSFCP3D	Distribuable	4 791 839,45	21 940,815	218,40

ELEMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres :	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) Les titres financiers éligibles et des instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1	55,49	55,32
b) Les titres financiers éligibles et des 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.	0,00	0,00
c) Les titres financiers éligibles et des 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	31,60	31,50
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00	0,00
e) Les autres actifs	8,64	8,62

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B) ET F) DE L'ARTICLE R.214-1-1, PAR DEVISE

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
			Actif net	Total des actifs
AMERIQUE 0%17 T-B.	USD	8 759 715,21	5,65	5,66
AMERIQUE 0%0917 TB	USD	7 434 223,49	4,80	4,78
DEERE	USD	4 420 086,10	2,85	2,84
CHIPOTLE MEXICAN	USD	4 129 643,01	2,67	2,66
SAMSUNG GDR 1995	USD	4 076 695,58	2,63	2,62
WAL MART STORES	USD	3 249 491,76	2,10	2,09
SCHWAB CHARLES	USD	3 038 708,52	1,96	1,95
NORDSTROM	USD	2 821 056,32	1,82	1,81
CRITEO ADR	USD	2 710 730,28	1,75	1,74
JETBLUE AIRWAYS	USD	2 200 578,34	1,42	1,42
COCA-COLA	USD	2 144 837,67	1,38	1,38
GENERAL ELECTRIC	USD	2 106 150,43	1,36	1,35
GRUBHUB	USD	2 080 245,71	1,34	1,34
CLOROX	USD	2 075 074,06	1,34	1,33
ATMOS ENERGY	USD	2 063 210,44	1,33	1,33
ALLY FINANCIAL	USD	2 014 546,09	1,30	1,30
KOHL S	USD	1 879 554,47	1,21	1,21
TOYOTA MOTOR ADR	USD	1 840 518,75	1,19	1,18
HILTON WORLDWIDE	USD	1 625 920,08	1,05	1,05
COLGATE PALMOLIVE	USD	1 510 791,75	0,98	0,97
MICHAEL KORS	USD	1 270 592,36	0,82	0,82
ADVANCE AUTO PARTS	USD	1 225 972,66	0,79	0,79
CANON ADR	USD	975 347,32	0,63	0,63
ALPHABET CL.C	USD	921 311,44	0,59	0,59
PITNEY BOWES ORD.	USD	661 584,30	0,43	0,43
LENDINGCLUB	USD	605 496,47	0,39	0,39
PAPA MURPHY S HLDG	USD	479 413,35	0,31	0,31
HILTON GRAND VACAT	USD	284 384,86	0,18	0,18
PARK HOTELS AND	USD	34 869,40	0,02	0,02
TOTAL	USD	68 640 750,22	44,29	44,17
FINCOBANK	EUR	4 382 970,15	2,84	2,81
AIR LIQUIDE	EUR	3 844 021,40	2,48	2,47
DEU.LUFTHANSA NOM.	EUR	3 663 789,08	2,36	2,36
TOD'S GROUP	EUR	3 123 447,60	2,02	2,01
BMW	EUR	2 774 736,64	1,79	1,79
ING GROEP	EUR	2 699 109,90	1,74	1,74
NEOPOST	EUR	2 263 635,90	1,46	1,46
DIRECT ENERGIE	EUR	2 124 400,00	1,37	1,37
UNILEVER	EUR	2 104 674,24	1,36	1,35
ILIAD	EUR	2 071 000,00	1,34	1,33
D'IETEREN DIVISION	EUR	2 046 000,00	1,32	1,32
DAIMLER	EUR	2 045 393,49	1,32	1,32
MICHELIN	EUR	1 950 514,80	1,26	1,25
WARTSILA	EUR	1 692 742,50	1,09	1,09
RED ELECTRICA	EUR	1 555 075,00	1,00	1,00

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
			Actif net	Total des actifs
CHRISTIAN DIOR	EUR	1 536 600,00	0,99	0,99
ANHEUS.BUSCH INBEV	EUR	1 063 810,00	0,69	0,68
DUERR	EUR	728 350,00	0,47	0,47
ZODIAC AEROSPACE	EUR	712 500,00	0,46	0,46
FINNAIR	EUR	236 599,51	0,15	0,15
TOTAL	EUR	42 619 370,21	27,51	27,42
MARKS SPENCER GRP	GBP	3 417 923,60	2,20	2,21
WHITBREAD	GBP	1 855 128,42	1,20	1,19
GREGGS	GBP	1 544 557,33	1,00	0,99
SAGA	GBP	1 428 815,12	0,92	0,92
PETS AT HOME GR	GBP	1 328 255,60	0,86	0,85
CARD FACTORY	GBP	239 969,07	0,15	0,15
TOTAL	GBP	9 814 649,14	6,33	6,31
NOVO NORDISK B	DKK	4 115 267,35	2,66	2,64
PANDORA	DKK	2 450 716,73	1,58	1,58
TOTAL	DKK	6 565 984,08	4,24	4,22
NESTLE NOM.	CHF	2 252 310,16	1,46	1,45
CHOCOLAD.LINDT BP	CHF	2 034 766,70	1,31	1,31
TOTAL	CHF	4 287 076,86	2,77	2,76
SVENSKA HANDEL A	SEK	1 450 983,22	0,94	0,93
ICA GRUPPEN	SEK	975 953,86	0,63	0,63
TOTAL	SEK	2 426 937,08	1,57	1,56
YAMATO	JPY	593 604,99	0,38	0,38
TOTAL	JPY	593 604,99	0,38	0,38
TOTAL		134 948 372,58	87,09	86,82

**REPARTITION DES ACTIFS DU A), B) ET F) DE L'ARTICLE R.214-1-1, PAR
SECTEUR ECONOMIQUE**

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Commerce de détail	14,73	14,71
Souverains	10,45	10,42
Voyage et Loisirs	9,36	9,33
Automobiles et équipementiers	6,86	6,84
Produits à usage domestique	5,73	5,71
Banques	5,51	5,49
Autres secteurs économiques	34,45	34,32
TOTAL	87,09	86,82

REPARTITION DES ACTIFS DU A), B) ET F) DE L'ARTICLE R.214-1-1, PAR PAYS DE RESIDENCE DE L'EMETTEUR

Pays	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
ETATS UNIS AMERIQUE	37,27	37,18
FRANCE	11,11	11,07
ROYAUME UNI	6,33	6,31
AUTRES PAYS	32,38	32,26
TOTAL	87,09	86,82

VENTILATION DES AUTRES ACTIFS PAR NATURE

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
PARTS D'OPC	8,64	8,62
▪ OPC et Fonds d'investissement à vocation générale (non-professionnels)	8,64	8,62
▪ FCPR, FCPI, FIP ouverts à des investisseurs non professionnels	0,00	0,00
▪ Organisme de titrisation	0,00	0,00
▪ OPCI, SCPI ouverts à des investisseurs non professionnels	0,00	0,00
▪ SEF, SICAF et fonds de fonds alternatifs	0,00	0,00
▪ Fonds professionnels à vocation générale (ouverts à des investisseurs professionnels)	0,00	0,00
▪ OPCI professionnels, Fonds professionnels spécialisés et fonds professionnels de capital investissements	0,00	0,00
▪ Autres placements collectifs	0,00	0,00
AUTRES NATURES D'ACTIFS	0,00	0,00
▪ Bons de souscription	0,00	0,00
▪ Bons de caisse	0,00	0,00
▪ Billets à ordre	0,00	0,00
▪ Billets hypothécaires	0,00	0,00
▪ Autres	0,00	0,00
TOTAL	8,64	8,62

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	65 675 549,12
Cessions	39 457 439,91

PORTEFEUILLE TITRES DETAILLE

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur boursière	% Actif Net
TOTAL Actions & valeurs assimilées					118 754 433,88	76,64
TOTAL Actions & valeurs assimilées négo. sur un marché régl. ou assimilé					118 754 433,88	76,64
TOTAL Actions & valeurs ass. nég. sur un marché régl. ou ass.(sauf Warrants et Bons de Sous.)					118 754 433,88	76,64
TOTAL BELGIQUE					3 109 810,00	2,01
BE0974259880 D'ETEREN PROV.DIVISION			EUR	50 000	2 046 000,00	1,32
BE0974293251 ANHEUSER-BUSCH INBEV			EUR	11 000	1 063 810,00	0,69
TOTAL SUISSE					4 287 076,86	2,77
CH0010570767 CHOCOLADEFABRIKEN LINDT BP			CHF	400	2 034 766,70	1,31
CH0038863350 NESTLE NOM.			CHF	29 500	2 252 310,16	1,46
TOTAL ALLEMAGNE					9 212 269,21	5,95
DE0005190003 BMW			EUR	34 138	2 774 736,64	1,79
DE0005565204 DUERR			EUR	7 000	728 350,00	0,47
DE0007100000 DAIMLER			EUR	32 277	2 045 393,49	1,32
DE0008232125 DEUTSCHE LUFTHANSA NOM.			EUR	183 879	3 663 789,08	2,37
TOTAL DANEMARK					6 565 984,08	4,24
DK0060252690 PANDORA			DKK	30 000	2 450 716,73	1,58
DK0060534915 NOVO NORDISK CL.B DIV.			DKK	109 769	4 115 267,35	2,66
TOTAL ESPAGNE					1 555 075,00	1,00
ES0173093024 RED ELECTRICA CORPORACION			EUR	85 000	1 555 075,00	1,00
TOTAL FINLANDE					1 929 342,01	1,25
FI0009003230 FINNAIR			EUR	36 911	236 599,51	0,15
FI0009003727 WARTSILA			EUR	32 710	1 692 742,50	1,10
TOTAL FRANCE					17 213 402,38	11,11
FR0000120073 AIR LIQUIDE			EUR	35 527	3 844 021,40	2,48
FR0000120560 NEOPOST			EUR	55 686	2 263 635,90	1,46
FR0000121261 MICHELIN			EUR	16 757	1 950 514,80	1,26
FR0000125684 ZODIAC AEROSPACE			EUR	30 000	712 500,00	0,46

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur boursière	% Actif Net
FR0000130403 CHRISTIAN DIOR			EUR	6 000	1 536 600,00	0,99
FR0004035913 ILIAD			EUR	10 000	2 071 000,00	1,34
FR0004191674 DIRECT ENERGIE			EUR	40 000	2 124 400,00	1,37
US2267181046 CRITEO ADR			USD	63 068	2 710 730,28	1,75
TOTAL ROYAUME UNI					9 814 649,14	6,33
GB0031274896 MARKS SPENCER GROUP NEW			GBP	901 735	3 417 923,60	2,20
GB00B1KJJ408 WHITBREAD			GBP	41 121	1 855 128,42	1,20
GB00B63QSB39 GREGGS			GBP	125 757	1 544 557,33	1,00
GB00BJ62K685 PETS AT HOME GR			GBP	725 000	1 328 255,60	0,86
GB00BLT1Y088 SAGA			GBP	600 000	1 428 815,12	0,92
GB00BLY2F708 CARD FACTORY			GBP	71 000	239 969,07	0,15
TOTAL ITALIE					7 506 417,75	4,84
IT0000072170 FINECOBANK			EUR	636 135	4 382 970,15	2,82
IT0003007728 TOD'S GROUP			EUR	57 206	3 123 447,60	2,02
TOTAL JAPON					3 409 471,06	2,20
JP3940000007 YAMATO			JPY	33 282	593 604,99	0,38
US1380063099 CANON ADR			USD	32 718	975 347,32	0,63
US8923313071 TOYOTA MOTOR ADR			USD	20 000	1 840 518,75	1,19
TOTAL REPUBLIQUE DE COREE DU SUD					4 076 695,58	2,63
US7960508882 SAMSUNG ELECTRON.GDR 1995			USD	4 495	4 076 695,58	2,63
TOTAL PAYS-BAS					4 803 784,14	3,10
NL0000009355 UNILEVER			EUR	43 557	2 104 674,24	1,36
NL0011821202 ING GROEP			EUR	178 749	2 699 109,90	1,74
TOTAL SUEDE					2 426 937,08	1,57
SE0000652216 ICA GRUPPEN			SEK	30 000	975 953,86	0,63
SE0007100599 SVENSKA HANDELSBANKEN A			SEK	115 980	1 450 983,22	0,94
TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE					41 572 927,23	26,82
US00751Y1064 ADVANCE AUTO PARTS			USD	12 000	1 225 972,66	0,79
US02005N1000 ALLY FINANCIAL			USD	110 000	2 014 546,09	1,30
US02079K1079 ALPHABET CL.C			USD	1 157	921 311,44	0,59

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur boursière	% Actif Net
US0495601058 ATMOS ENERGY			USD	28 385	2 063 210,44	1,33
US1696561059 CHIPOTLE MEXICAN GRILL			USD	11 326	4 129 643,01	2,67
US1890541097 CLOROX			USD	17 773	2 075 074,06	1,34
US1912161007 COCA-COLA			USD	54 575	2 144 837,67	1,38
US1941621039 COLGATE PALMOLIVE			USD	23 258	1 510 791,75	0,98
US2441991054 DEERE			USD	40 814	4 420 086,10	2,85
US3696041033 GENERAL ELECTRIC			USD	88 987	2 106 150,43	1,36
US4001101025 GRUBHUB			USD	54 449	2 080 245,71	1,34
US43283X1054 HILTON GRAND VACATIONS			USD	9 000	284 384,86	0,18
US43300A2033 HILTON WORLDWIDE HOLDINGS			USD	30 000	1 625 920,08	1,05
US4771431016 JETBLUE AIRWAYS			USD	110 000	2 200 578,34	1,42
US5002551043 KOHL S			USD	55 468	1 879 554,47	1,21
US52603A1097 LENDINGCLUB			USD	125 407	605 496,47	0,39
US6556641008 NORDSTROM			USD	67 309	2 821 056,32	1,82
US6988141007 PAPA MURPHY S HOLDINGS			USD	125 196	479 413,35	0,31
US7005171050 PARK HOTELS AND RESORTS			USD	1 476	34 869,40	0,02
US7244791007 PITNEY BOWES ORD.			USD	50 000	661 584,30	0,43
US8085131055 SCHWAB CHARLES			USD	80 721	3 038 708,52	1,96
US9311421039 WAL MART STORES			USD	49 000	3 249 491,76	2,10
TOTAL VIERGES BRITANNIQUES					1 270 592,36	0,82
VGG607541015 MICHAEL KORS			USD	40 000	1 270 592,36	0,82
TOTAL Titres de créances					16 193 938,70	10,45
TOTAL Titres de créances négociés sur un marché régl. ou assimilé					16 193 938,70	10,45
TOTAL Titres de créances négociables					16 193 938,70	10,45
TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE					16 193 938,70	10,45
US912796KB41 AMERIQUE 0%16-200717 T-BILLS	19/07/2016	20/07/2017	USD	100 000	8 759 715,21	5,65
US912796KL23 AMERIQUE 0%16-140917 T-BILLS	13/09/2016	14/09/2017	USD	85 000	7 434 223,49	4,80
TOTAL Titres d'OPC					13 392 924,49	8,64
TOTAL OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'UE					13 392 924,49	8,64
TOTAL FRANCE					13 392 924,49	8,64

Désignation des valeurs	Emission	Echéance	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur boursière	% Actif Net
FR0000984254 UNION DOLLAR CASH FCP 3DEC			USD	4 115,949	6 372 074,78	4,11
FR0007476734 MEYERBEER TRESORERIE C FCP3DEC			EUR	3 418,518	7 020 849,71	4,53

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.