



KPMG S.A.
Siège social
Tour EQHO
2 avenue Gambetta
CS 60055
92066 Paris La Défense Cedex
France

Téléphone : +33 (0)1 55 68 86 66
Télécopie : +33 (0)1 55 68 86 60
Site internet : www.kpmg.fr

Fonds Commun de Placement

TRUSTEAM ROC

Attestation du commissaire aux comptes

sur la composition de l'actif au 28 septembre 2018



KPMG S.A.
Siège social
Tour EQHO
2 avenue Gambetta
CS 60055
92066 Paris La Défense Cedex
France

Téléphone : +33 (0)1 55 68 86 66
Télécopie : +33 (0)1 55 68 86 60
Site internet : www.kpmg.fr

Fonds Commun de Placement
TRUSTEAM ROC

10, rue Lincoln - 75008 Paris

Attestation du commissaire aux comptes
sur la composition de l'actif au 28 septembre 2018

En notre qualité de commissaire aux comptes du fonds et en application des dispositions du règlement général de l'Autorité des marchés financiers relatives au contrôle de la composition de l'actif, nous avons établi la présente attestation sur les informations figurant dans la composition de l'actif au 28 septembre 2018 ci-jointe.

Ces informations ont été établies sous la responsabilité de la société de gestion du fonds. Il nous appartient de nous prononcer sur la cohérence des informations contenues dans la composition de l'actif avec la connaissance que nous avons du fonds acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

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, qui ne constituent ni un audit ni un examen limité, ont consisté essentiellement à réaliser des procédures analytiques et des entretiens avec les personnes qui produisent et contrôlent les informations données.

Sur la base de nos travaux, nous n'avons pas d'observation à formuler sur la cohérence des informations figurant dans le document joint avec la connaissance que nous avons du fonds acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

Paris La Défense, le 8 novembre 2018

KPMG S.A.

Gérard Gaultry
Associé

Stock : Stock adm principal au 28/09/18
PORTEFEUILLE : F5749 TRUSTEAM ROC

Devise de fixing : FXF Dev. BCE 14H
Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifiée, trame : GLASST COB COMPLET(TL1), Tris : BVAL)

V	A	L	E	U	R	STATUTS VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	← PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPOUR TOTA	PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
PORTEFEUILLE TITRES																	
Actions & valeurs assimilées																	
Actions & valeurs assimilées nég. sur un marché régl. ou assimilé																	
Actions & valeurs ass. nég. sur un marché régl. ou ass. (sauf Warrants et Bons de Sous.)																	
DEVISE VALEUR : DKK COURONNE DANOISE																	
DK0010268606							38,000.	P DKK	405,8124	M 28/09/18	434,4		2,071,833.42	2,213,829.73	0,00	141,996.31	1,64
DK0060252690							15,000.	P DKK	687,7506	M 28/09/18	401,1		1,387,046.88	806,890.72	0,00	-580,156.16	0,60
DK0060534915							49,769.	P DKK	291,5616	M 28/09/18	302,4		1,948,686.27	2,018,419.83	0,00	69,733.56	1,50
DEVISE VALEUR : EUR EURO																	
BE0974259880							80,332.	P EUR	41,8561	M 28/09/18	37,92		3,362,382.90	3,046,189.44	0,00	-316,193.46	2,26
DE0005089031							10,000.	P EUR	41,8615	M 28/09/18	40,75		418,615.00	407,500.00	0,00	-11,115.00	0,30
DE0005545503							30,000.	P EUR	42,4904	M 28/09/18	41,9		1,274,712.00	1,257,000.00	0,00	-17,712.00	0,93
DE0005557508							170,000.	P EUR	15,2572	M 28/09/18	13,885		2,593,716.60	2,360,450.00	0,00	-233,266.60	1,75
DE0005772206							41,000.	P EUR	60,4753	M 28/09/18	51,85		2,479,489.26	2,125,850.00	0,00	-353,639.26	1,58
DE0007100000							7,277.	P EUR	56,7927	M 28/09/18	54,35		413,280.62	395,504.95	0,00	-17,775.67	0,29
DE0008FB0019							40,000.	P EUR	12,0091	M 28/09/18	13,5		480,364.00	540,000.00	0,00	59,636.00	0,40
ES0105229001							200,000.	P EUR	2,3366	M 28/09/18	1,888		467,320.00	377,600.00	0,00	-89,720.00	0,28
ES0113211835							400,000.	P EUR	7,2779	M 28/09/18	5,49		2,911,155.00	2,196,000.00	0,00	-715,155.00	1,63
ES0161560018							175,000.	P EUR	6,3556	M 28/09/18	6,285		1,112,222.50	1,099,875.00	0,00	-12,347.50	0,81
ES0173093024							85,000.	P EUR	17,1864	M 28/09/18	18,04		1,460,847.50	1,533,400.00	0,00	72,552.50	1,14
ES0175438003							130,000.	P EUR	9,9767	M 28/09/18	5,35		776,967.00	695,500.00	0,00	-81,467.00	0,52
ES0176252718							150,000.	P EUR	9,6635	M 28/09/18	9,64		1,449,525.00	1,446,000.00	0,00	-3,525.00	1,07
FI0009003230							36,911.	P EUR	5,5159	M 28/09/18	7,17		203,597.38	264,651.87	0,00	61,054.49	0,20
FR0000075442							138,000.	P EUR	18,	M 28/09/18	15,48		2,484,000.00	2,136,240.00	0,00	-347,760.00	1,58
FR0000120073							16,279.	P EUR	89,9099	M 28/09/18	113,3		1,463,644.05	1,844,410.70	0,00	380,766.65	1,37
FR0000120560							165,186.	P EUR	26,7192	M 28/09/18	26,18		4,413,639.88	4,324,569.48	0,00	-89,070.40	3,20
FR0004035973							15,000.	P EUR	136,6591	M 28/09/18	112,5		2,049,887.00	1,687,500.00	0,00	-362,387.00	1,25
FR0004191674							175,699.	P EUR	39,3601	M 28/09/18	42,		6,915,529.74	7,379,358.00	0,00	463,828.26	5,47
FR0012938884							440,000.	P EUR	1,0311	M 28/09/18	1,		453,693.00	440,000.00	0,00	-13,693.00	0,33
IT0003007728							1,615,000.	P GBP	0,5972	M 28/09/18	0,579		1,078,532.85	1,053,854.39	0,00	-24,678.46	0,78
IT0003697080							47,206.	P EUR	66,1051	M 28/09/18	58,75		3,120,559.68	2,773,352.50	0,00	-347,207.18	2,05
NL000009082							800,000.	P EUR	2,9999	M 28/09/18	2,17		2,399,930.00	1,736,000.00	0,00	-663,930.00	1,29
NL0011821392							500,000.	P EUR	2,3031	M 28/09/18	2,272		1,151,540.00	1,136,000.00	0,00	-15,540.00	0,84
US2267181046							79,441.	P EUR	23,5949	M 28/09/18	22,3		1,874,402.28	1,771,534.30	0,00	-102,867.98	1,31
US2267181046							108,068.	P USD	39,3285	M 28/09/18	22,94		3,773,019.86	2,141,568.69	0,00	-1,631,451.17	1,59
DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING																	
GB0031274896							956,904.	P GBP	3,8249	M 28/09/18	2,888		4,567,798.50	3,114,548.35	0,00	-1,453,250.15	2,31
GB0081722M11							50,923.	P GBP	5,3164	M 28/09/18	9,325		294,666.59	535,170.72	0,00	240,504.13	0,40
GB0081KJ1408							7,282.	P GBP	39,3056	M 28/09/18	47,17		337,518.14	387,120.41	0,00	49,602.27	0,29
GB00853QS839							109,255.	P GBP	10,2184	M 28/09/18	10,55		1,375,108.56	1,299,042.32	0,00	-76,066.24	0,96
GB008J62K685							1,025,000.	P GBP	1,9106	M 28/09/18	1,194		1,379,296.74	1,299,042.32	0,00	-80,254.42	0,61
GB00BL1Y088							526,146.	P GBP	2,0782	M 28/09/18	1,308		1,288,418.43	775,610.24	0,00	-512,808.19	0,57
DEVISE VALEUR : JPY YEN																	
JP3940000007							33,282.	P JPY	2510,244	M 28/09/18	3488,		612,967.25	884,611.87	0,00	271,644.62	0,66
US1380063099							32,718.	P USD	32,2396	M 28/09/18	31,65		820,624.46	894,544.49	0,00	73,920.03	0,66
DEVISE VALEUR : KRW WON SUD COREEN																	
US1960508882							3,900.	P USD	625,1945	M 28/09/18	1047,		1,849,219.94	3,527,384.24	0,00	1,678,164.30	2,61



Stock : Stock admi principal au 28/09/18
PORTEFEUILLE : F5749 TRUSTEAM ROC

Devise de fixing : FXF Dev. BCE 14H
Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifié, trame : CLASST COB COMPLET(TL1), Tris : BVAL)

V	A	L	E	U	R	STATUTS VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P. R. U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	← PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPEUR COURTOTA	PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
DEVISE VALEUR : NOK COUVRONNE NORVEGIENNE																	
N00010063308	TELEOR		25.385.		P USD		44.0132	M 28/09/18	159.1				446,274.24	420,165.85	0.00	-26,108.39	0.31
N00010582521	GJENSID FORSIKR		11.326.		P USD		571.8928	M 28/09/18	137.2				434,539.46	434,796.39	0.00	256.93	0.32
N00010739402	SBANKEN		3.773.		P USD		89.5941	M 28/09/18	88.7				514,283.08	562,193.00	0.00	47,899.92	0.42
DEVISE VALEUR : SEK COUVRONNE SUEDOISE																	
SE0000806994 JM			84.000.		P SEK		214.4839	M 28/09/18	174.5				1,845,577.10	1,421,864.39	0.00	-423,712.71	1.05
SE0007100599	SVENSKA HANDEL A		235.980.		P SEK		101.1614	M 28/09/18	112.25				2,469,188.62	2,569,478.61	0.00	100,289.99	1.90
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US																	
US0495601058	ATMOS ENERGY		25.385.		P USD		44.0132	M 28/09/18	93.91				882,299.54	2,059,351.55	0.00	1,177,053.01	1.53
US1696561059	CHIPOTLE MEXICAN		11.326.		P USD		571.8928	M 28/09/18	454.52				5,688,243.27	4,447,040.01	0.00	-1,241,203.26	3.29
US1890541097	CLOROX		3.773.		P USD		89.5941	M 28/09/18	150.41				268,905.94	490,235.77	0.00	221,329.83	0.36
US1912161007	COCA-COLA		54.575.		P USD		39.6164	M 28/09/18	46.19				1,680,494.97	2,177,625.48	0.00	497,130.51	1.61
US1941621039	COLGATE PALMOLIVE		23.258.		P USD		62.1614	M 28/09/18	66.95				1,214,132.84	1,345,130.53	0.00	130,997.69	1.00
US2441910054	DEERE		13.814.		P USD		83.5987	M 28/09/18	150.33				982,998.47	1,793,934.54	0.00	810,936.07	1.33
US3696041033	GENERAL ELECTRIC		253.987.		P USD		21.3265	M 28/09/18	11.29				4,505,657.56	2,477,119.24	0.00	-2,028,538.32	1.84
US43283X1054	HILTON GRAND VACAT		9.000.		P USD		0.	M 28/09/18	33.1				0.00	257,342.78	0.00	257,342.78	0.19
US43300A2033	HILTON WORLDWIDE		30.000.		P USD		66.5015	M 28/09/18	80.78				1,780,893.84	2,093,469.25	0.00	312,575.41	1.55
US4771431016	JETBLUE AIRWAYS		180.000.		P USD		22.409	M 28/09/18	19.36				3,548,817.34	3,010,366.28	0.00	-538,451.06	2.23
US5002551043	KOHL S		28.468.		P USD		46.8737	M 28/09/18	74.55				1,126,806.58	1,833,352.97	0.00	706,546.39	1.36
US52603A1097	LENDINGCLUB		125.407.		P USD		10.3058	M 28/09/18	3.88				1,166,193.39	420,334.45	0.00	-745,858.94	0.31
US6556641008	NORDSTROM		40.309.		P USD		50.9287	M 28/09/18	59.81				1,711,218.65	2,082,654.88	0.00	371,436.23	1.54
US6988141007	PAPA MURPHY S HDLG		125.196.		P USD		12.8035	M 28/09/18	5.19				1,391,594.78	561,305.49	0.00	-830,289.29	0.42
US7005171050	PARK HOTELS AND		1.476.		P USD		26.6134	M 28/09/18	32.82				37,229.98	41,847.20	0.00	4,617.22	0.03
US8085131055	SCHWAB CHARLES		28.721.		P USD		26.1193	M 28/09/18	49.15				651,942.99	1,219,451.58	0.00	567,508.59	0.90
US8447411088	SOUTHWEST AIRLINES		66.000.		P USD		55.2823	M 28/09/18	62.45				3,069,360.34	3,560,556.32	0.00	491,195.98	2.64
US8923313071	TOYOTA MOTOR ADR		20.000.		P USD		109.2372	M 28/09/18	124.35				2,013,902.11	2,148,410.50	0.00	134,508.39	1.59
US9311421039	WAL MART STORES		15.000.		P USD		60.7932	M 28/09/18	90.88				740,893.04	1,177,608.85	0.00	436,715.81	0.87
VG6607541015	MICHAEL KORS		57.000.		P USD		75.1059	M 28/09/18	93.91				3,830,712.95	4,624,110.23	0.00	793,397.28	3.43
Actions & valeurs ass. nég. sur un marché régl. ou ass.(sauf Warrants et Bons de Sous.)																	
			40.000.		P USD		43.937	M 28/09/18	68.56				1,627,233.25	2,369,039.39	0.00	741,806.14	1.76
								CUMUL (EUR)					113,077,322.97	109,605,164.51	0.00	-3,472,158.46	81.21
Actions & valeurs assimilées nég. sur un marché régl. ou assimilé																	
								CUMUL (EUR)					113,077,322.97	109,605,164.51	0.00	-3,472,158.46	81.21
Actions & valeurs assimilées																	
								CUMUL (EUR)					113,077,322.97	109,605,164.51	0.00	-3,472,158.46	81.21
Titres de créances																	
Titres de créances négociés sur un marché régl. ou assimilé																	
Titres de créances négociables																	
			50.000.		P USD		99.5555	% 28/09/18	99.86258				4,271,830.83	4,313,345.72	0.00	41,514.89	3.20
US9127960E26	AMERIQUE 0%18 T-B.																
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US																	
EXA-25/10/18																	

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/09/18
 PORTEFEUILLE : F5749 TRUSTEAM R0C

VL VALIDEE Devise de fixing : FXF Dev. BCE 14H
 Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : CLASST COB COMPLET(TL1), Tris : BVAL)

V	A	L	E	U	R	STATUTS VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P. R. U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
Coupons et dividendes																	
DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING																	
6800B1722W11						DART GROUP	50,923.	P GBP	0.06	28/09/18	0.		3,440.24	3,443.46	0.00	3.22	0.00
6800B63QSB39						GREGGS	109,255.	P GBP	0.10700005	28/09/18	0.		12,942.04	13,175.13	0.00	233.09	0.01
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING																	
										CUMUL (EUR)			16,382.28	16,618.59	0.00	236.31	0.01
DEVISE VALEUR : JPY YEN																	
JP3940000007						YAMATO	33,282.	P JPY	12.59999399	28/09/18	0.		3,158.25	3,195.56	0.00	37.31	0.00
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : JPY YEN																	
										CUMUL (EUR)			3,158.25	3,195.56	0.00	37.31	0.00
DEVISE VALEUR : NOK COUROMNE NORVEGIEENNE																	
N00010063308						TELEINOR	25,000.	P NOK	3.3	28/09/18	0.		8,604.06	8,714.94	0.00	110.88	0.01
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : NOK COUROMNE NORVEGIEENNE																	
										CUMUL (EUR)			8,604.06	8,714.94	0.00	110.88	0.01
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US																	
US1912161007						C0CA-COLA	54,575.	P USD	0.273000009	28/09/18	0.		12,860.58	12,870.58	0.00	10.00	0.01
US2441991054						DEERE	13,814.	P USD	0.48299986	28/09/18	0.		5,684.72	5,763.79	0.00	79.07	0.00
US3696041033						GENERAL ELECTRIC	253,987.	P USD	0.084000001	28/09/18	0.		18,430.51	18,430.30	0.00	69.79	0.01
US43300A2033						HILTON WORLDWIDE	30,000.	P USD	0.105	28/09/18	0.		2,718.09	2,721.15	0.00	3.06	0.00
US7005171050						PARK HOTELS AND	1,476.	P USD	0.30100271	28/09/18	0.		378.53	383.79	0.00	5.26	0.00
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US																	
										CUMUL (EUR)			40,002.43	40,169.61	0.00	167.18	0.03
Coupons et dividendes																	
Frais de gestion																	
Frais de gestion																	
FGES.EUR						Prov frais gestion	-149,585.08	EUR	1.		1.		-149,585.08	-149,585.08	0.00	0.00	-0.11
Frais de gestion																	
Frais de gestion																	
										CUMUL (EUR)			-149,585.08	-149,585.08	0.00	0.00	-0.11
Frais de gestion																	
Frais de gestion																	
										CUMUL (EUR)			-149,585.08	-149,585.08	0.00	0.00	-0.11
Dettes et créances																	
										CUMUL (EUR)			36,377.63	36,929.31	0.00	551.68	0.03

Stock : Stock adm. principal au 28/09/18
PORTEFEUILLE : F5749 TRUSTEAM ROC

VL VALIDEE
Devise de fixing : FXF Dev. BCE 14H
Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifié, trame : CLASST COB COMPLET(TL1), Tris : BVAL)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P. R. U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
Disponibilités												
Comptes à vue												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
B001. EUR	Banque	807,845.81	EUR	1.		1.		807,845.81	806,474.36	-1,371.45	-1,371.45	0.60
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO												
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US												
B001. USD	Banque	12,493,507.76	USD	0.85198712		0.86385625		10,644,307.74	10,792,594.82	0.00	148,287.08	8.00
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US												
Comptes à vue												
Disponibilités												
TRESORERIE												
								11,452,153.55	11,599,069.18	-1,371.45	146,915.63	8.59
								11,452,153.55	11,599,069.18	-1,371.45	146,915.63	8.59
								11,488,531.18	11,635,996.49	-1,371.45	147,467.31	8.62

PORTEFEUILLE : TRUSTEAM ROC (F5749)												(EUR)			
											138,632,473.22	134,969,520.25	-1,371.45	-3,662,952.97	100.00

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/09/18
PORTEFEUILLE : F5749 TRUSTEAM ROC

VL VAL IDEE
Devise de fixing : FXF Dev. BCE 14H
Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifiée, trame : CLASST C08 COMPLET(TL1), Tris : BVAL)

Portefeuille titres : 123,333,521.76 Coupons et dividendes a recevoir : 68,698.7

Frais de gestion du jour
C1 Prov frais gestion : 3,636.76 EUR
C2 Prov frais gestion : 1,661.14 EUR

Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coeff. actif	Coeff. passif	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
C1 FR0010981175 PART CAPI A	EUR	66,291,053.58	165,793,307	399.84	49.116339807457			399.84	399.84
C2 FR0010985804 PART CAPI B	EUR	60,467,276.48	140,482,503	430.43	44.800162317907			430.43	430.43
D3 FR0013176062 PART DIST S	EUR	8,211,190.19	36,695.33	223.77	6.083497874635			223.77	223.77

Actif net total en EUR : 134,969,520.25

Fiscalite de l'epargne : poids et statuts des parts du portefeuille

Type reporting : TISF TIS France

Poids officiels et statuts en date du 29/12/17 :

Poids DD : 11.8 Statut DD : I

Poids DI : 19.19 Statut DI : 0

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock adm. principal au 28/09/18
 PORTEFEUILLE : F5749 TRUSTEAM ROC

VL VAL IDEE
 Devise de fixing : FXF Dev. BCE 14H
 Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifié, trame : CLASST COB COMPLET(TL1), Tris : BVAL)

COURS DES DEVICES UTILISEES										
par la valorisation			par l'inventaire				par la valorisation précédente			variation
Cours EUR en DKK :	7.4564	cotation :	28/09/18	0.	7.4591	cotation :	27/09/18	-0.0362		
Cours EUR en GBP :	0.8873	cotation :	28/09/18	0.	0.88973	cotation :	27/09/18	-0.27312		
Cours EUR en JPY :	131.23	cotation :	28/09/18	0.	132.15	cotation :	27/09/18	-0.69618		
Cours EUR en NOK :	9.4665	cotation :	28/09/18	0.	9.5015	cotation :	27/09/18	-0.36836		
Cours EUR en SEK :	10.309	cotation :	28/09/18	0.	10.3208	cotation :	27/09/18	-0.11433		
Cours EUR en USD :	1.1576	cotation :	28/09/18	0.	1.1707	cotation :	27/09/18	-1.11899		
Equity Fund - Poids calcule de 81,3 % (pour un seuil de 51. %)										

