

TRUSTEAM ROC EUROPE

DOCUMENT D'INFORMATION PERIODICITE SEMESTRIELLE AU 30/12/2016

FORME JURIDIQUE DE L'OPC

FCP Général

CLASSIFICATION

Actions des Pays de l'Union Européenne

AFFECTATION DES RESULTATS

Résultat capitalisable

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	121 736 308,86
b) Avoirs bancaires	20 175 798,35
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	14 630 944,82
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	156 543 052,03
e) Passif	-214 650,38
f) Valeur nette d'inventaire	156 328 401,65

* 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 TRUS.ROC EUROP.A3D	Capitalisable	108 691 963,78	543 672,336	199,92
C2 TRUS.ROC EUROP.B3D	Capitalisable	47 636 437,87	231 899,358	205,42

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	76,94	76,84
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	0,93	0,93
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	9,27	9,26

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
AIR LIQUIDE	EUR	6 687 011,10	4,27	4,26
TOD'S GROUP	EUR	5 428 326,60	3,47	3,47
BMW	EUR	5 375 055,00	3,44	3,43
ING GROEP	EUR	5 351 075,10	3,42	3,42
FINECOBANK	EUR	5 122 844,22	3,28	3,27
ILIAD	EUR	4 931 550,00	3,15	3,15
GPE EUROTUN.REGPT	EUR	4 697 680,00	3,01	3,00
DAIMLER	EUR	4 667 307,84	2,99	2,98
WARTSILA	EUR	4 592 026,56	2,94	2,93
MICHELIN	EUR	4 566 240,00	2,92	2,92
NEOPOST	EUR	3 800 534,16	2,43	2,43
RED ELECTRICA	EUR	3 775 865,40	2,42	2,41
DUERR	EUR	3 696 790,65	2,36	2,36
HUGO BOSS NOM.	EUR	3 609 117,31	2,31	2,31
FAIVELEY TRANSPORT	EUR	3 204 480,00	2,05	2,05
SAMSE	EUR	3 016 506,00	1,93	1,93
UNILEVER	EUR	2 738 050,00	1,75	1,75
KORIAN	EUR	2 531 240,64	1,62	1,62
PRYSMIAN	EUR	2 159 717,20	1,38	1,38
DEU.LUFTHANSA NOM.	EUR	2 085 900,00	1,33	1,33
FIELMANN	EUR	2 056 192,00	1,32	1,31
AXA	EUR	1 918 800,00	1,23	1,23
KON.DSM NOM.	EUR	1 875 863,68	1,20	1,20
EOS IMAGING	EUR	1 822 871,40	1,17	1,16
SOLOCAL GROUP RGPT	EUR	1 599 146,52	1,02	1,02
DIRECT ENERGIE	EUR	1 547 987,70	0,99	0,99
ADP	EUR	1 527 000,00	0,98	0,98
IPSOS	EUR	596 900,00	0,38	0,38
ONTEX GROUP	EUR	424 823,50	0,27	0,27
MAISONS DU MONDE	EUR	375 675,00	0,24	0,24
FINNAIR	EUR	198 276,00	0,13	0,13
TOTAL	EUR	95 980 853,58	61,40	61,31
MARKS SPENCER GRP	GBP	5 356 748,00	3,43	3,42
PETS AT HOME GR	GBP	3 117 216,78	1,99	1,99
GREGGS	GBP	1 285 274,36	0,82	0,82
DUNELM GROUP	GBP	1 214 013,41	0,78	0,78
CARD FACTORY	GBP	280 723,68	0,18	0,18
TOTAL	GBP	11 253 976,23	7,20	7,19
SVENSKA HANDEL A	SEK	3 023 715,59	1,93	1,93
SKF SIE B	SEK	1 308 288,85	0,84	0,84
JM	SEK	468 400,94	0,30	0,30
ICA GRUPPEN	SEK	436 377,91	0,28	0,28
TOTAL	SEK	5 236 783,29	3,35	3,35
NOVO NORDISK B	DKK	4 361 288,70	2,79	2,79
TOTAL	DKK	4 361 288,70	2,79	2,79

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage	
			Actif net	Total des actifs
CLARIANT NOM.	CHF	1 515 496,35	0,97	0,97
ARYZTA	CHF	1 059 001,26	0,68	0,68
CHOCOLAD.LINDT BP	CHF	584 528,35	0,37	0,37
TOTAL	CHF	3 159 025,96	2,02	2,02
CRITEO ADR	USD	1 458 318,57	0,93	0,93
TOTAL	USD	1 458 318,57	0,93	0,93
SKANDIABANKEN	NOK	286 062,53	0,18	0,18
TOTAL	NOK	286 062,53	0,18	0,18
TOTAL		121 736 308,86	77,87	77,77

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	11,16	11,13
Automobiles et équipementiers	9,34	9,33
Banques	8,82	8,81
Ingénierie Industrielle	8,19	8,18
Chimie	6,45	6,44
Produits à usage domestique	4,33	4,33
Autres secteurs économiques	29,58	29,55
TOTAL	77,87	77,77

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
FRANCE	28,33	28,28
ALLEMAGNE	13,75	13,73
ITALIE	8,13	8,12
AUTRES PAYS	27,66	27,64
TOTAL	77,87	77,77

VENTILATION DES AUTRES ACTIFS PAR NATURE

Nature d'actifs	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
PARTS D'OPC	9,27	9,26
▪ OPC et Fonds d'investissement à vocation générale (non-professionnels)	9,27	9,26
▪ 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	9,27	9,26

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	39 165 005,71
Cessions	50 578 695,58

PORTEFEUILLE TITRES DETAILLE

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur boursière	% Actif Net
TOTAL Actions & valeurs assimilées			121 736 308,86	77,87
TOTAL Actions & valeurs assimilées négo. sur un marché régl. ou assimilé			121 736 308,86	77,87
TOTAL Actions & valeurs ass. nég. sur un marché régl. ou ass.(sauf Warrants et Bons de Sous.)			121 736 308,86	77,87
TOTAL BELGIQUE			424 823,50	0,27
BE0974276082 ONTEX GROUP	EUR	15 038	424 823,50	0,27
TOTAL SUISSE			3 159 025,96	2,02
CH0010570767 CHOCOLADEFABRIKEN LINDT BP	CHF	119	584 528,35	0,37
CH0012142631 CLARIANT NOM.	CHF	92 629	1 515 496,35	0,97
CH0043238366 ARYZTA	CHF	25 357	1 059 001,26	0,68
TOTAL ALLEMAGNE			21 490 362,80	13,75
DE0005190003 BMW	EUR	60 564	5 375 055,00	3,44
DE0005565204 DUERR	EUR	48 419	3 696 790,65	2,36
DE0005772206 FIELMANN	EUR	32 768	2 056 192,00	1,32
DE0007100000 DAIMLER	EUR	65 997	4 667 307,84	2,99
DE0008232125 DEUTSCHE LUFTHANSA NOM.	EUR	170 000	2 085 900,00	1,33
DE000A1PHFF7 HUGO BOSS NOM.	EUR	62 087	3 609 117,31	2,31
TOTAL DANEMARK			4 361 288,70	2,79
DK0060534915 NOVO NORDISK CL.B DIV.	DKK	127 301	4 361 288,70	2,79
TOTAL ESPAGNE			3 775 865,40	2,42
ES0173093024 RED ELECTRICA CORPORACION	EUR	210 648	3 775 865,40	2,42
TOTAL FINLANDE			4 790 302,56	3,06
FI0009003230 FINNAIR	EUR	49 200	198 276,00	0,13
FI0009003727 WARTSILA	EUR	107 592	4 592 026,56	2,93
TOTAL FRANCE			44 281 941,09	28,33
FR0000053142 FAIVELEY TRANSPORT	EUR	32 000	3 204 480,00	2,05
FR0000060071 SAMSE	EUR	20 661	3 016 506,00	1,93
FR0000073298 IPSOS	EUR	20 000	596 900,00	0,38

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur boursière	% Actif Net
FR0000120073 AIR LIQUIDE	EUR	63 294	6 687 011,10	4,28
FR0000120560 NEOPOST	EUR	127 878	3 800 534,16	2,43
FR0000120628 AXA	EUR	80 000	1 918 800,00	1,23
FR0000121261 MICHELIN	EUR	43 200	4 566 240,00	2,92
FR0004035913 ILIAD	EUR	27 000	4 931 550,00	3,15
FR0004191674 DIRECT ENERGIE	EUR	43 361	1 547 987,70	0,99
FR0010340141 AEROPORTS DE PARIS	EUR	15 000	1 527 000,00	0,98
FR0010386334 KORIAN	EUR	90 921	2 531 240,64	1,62
FR0010533075 GROUPE EUROTUNNEL REGROUPT	EUR	520 000	4 697 680,00	3,01
FR0011191766 EOS IMAGING	EUR	434 017	1 822 871,40	1,17
FR0012938884 SOLOCAL GROUP RGPT	EUR	518 530	1 599 146,52	1,02
FR0013153541 MAISONS DU MONDE	EUR	15 000	375 675,00	0,24
US2267181046 CRITEO ADR	USD	37 420	1 458 318,57	0,93
TOTAL ROYAUME UNI			11 253 976,23	7,20
GB0031274896 MARKS SPENCER GROUP NEW	GBP	1 310 383	5 356 748,00	3,43
GB00B1CKQ739 DUNELM GROUP	GBP	129 200	1 214 013,41	0,78
GB00B63QSB39 GREGGS	GBP	113 446	1 285 274,36	0,82
GB00BJ62K685 PETS AT HOME GR	GBP	1 116 694	3 117 216,78	1,99
GB00BLY2F708 CARD FACTORY	GBP	95 000	280 723,68	0,18
TOTAL ITALIE			12 710 888,02	8,13
IT0000072170 FINECOBANK	EUR	961 134	5 122 844,22	3,28
IT0003007728 TOD'S GROUP	EUR	87 837	5 428 326,60	3,47
IT0004176001 PRYSMIAN	EUR	88 513	2 159 717,20	1,38
TOTAL PAYS-BAS			9 964 988,78	6,37
NL0000009355 UNILEVER	EUR	70 000	2 738 050,00	1,75
NL0000009827 KONINKLIJKE DSM NOM.	EUR	32 933	1 875 863,68	1,20
NL0011821202 ING GROEP	EUR	400 230	5 351 075,10	3,42
TOTAL NORVEGE			286 062,53	0,18
NO0010739402 SKANDIABANKEN	NOK	37 000	286 062,53	0,18
TOTAL SUEDE			5 236 783,29	3,35

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur boursière	% Actif Net
SE0000108227 SKF SIE B	SEK	74 567	1 308 288,85	0,84
SE0000652216 ICA GRUPPEN	SEK	15 000	436 377,91	0,28
SE0000806994 JM	SEK	17 000	468 400,94	0,30
SE0007100599 SVENSKA HANDELSBANKEN A	SEK	228 152	3 023 715,59	1,93
TOTAL Titres d'OPC			14 494 264,00	9,27
TOTAL OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'UE			14 494 264,00	9,27
TOTAL FRANCE			14 494 264,00	9,27
FR0007476734 MEYERBEER TRESORERIE C FCP3DEC	EUR	3 000	6 166 710,00	3,94
FR0010220038 TRUSTEAM ROC PME	EUR	4 000	816 480,00	0,52
FR0010316216 TRUSTEAM OPTIMUM B FCP 3DEC	EUR	25 000	4 140 250,00	2,65
FR0010320887 TAUX REELS EUROPEE.AC FCP 4DEC	EUR	30	321 015,00	0,21
FR0010602540 VALEURS CROISS.RDM IC FCP 4DEC	EUR	6 800	1 608 404,00	1,03
FR0010985804 TRUSTEAM ROC PART B FCP 3DEC	EUR	3 500	1 441 405,00	0,92

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.