



**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](http://www.kpmg.fr)

# Fonds Commun de Placement

## TRUSTEAM ROC EUROPE

*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](http://www.kpmg.fr)

**Fonds Commun de Placement  
TRUSTEAM ROC EUROPE**

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 admi principal au 28/09/18  
PORTEFEUILLE : F5264 TRUSTEAM ROC EUROPE

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

(Etat simplifiée, trame : CLASST COB COMPLET(TL), 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	F	PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
<b>PORTEFEUILLE TITRES</b>																	
<b>Actions &amp; valeurs assimilées</b>																	
<b>Actions &amp; valeurs assimilées négo. sur un marché régl. ou assimilé</b>																	
<b>Actions &amp; valeurs ass. nég. sur un marché régl. ou ass. (sauf Warrants et Bons de Sous.)</b>																	
<b>DEVISE VALEUR : DKK COURONNE DANOISE</b>																	
DK0010268606	VESTAS WIND SYST.	P	DKK	406.9202	M	28/09/18	434.4						3,717,678.27	3,961,590.04	0.00	243,911.77	2.97
DK0060252690	PANDORA	P	DKK	663.2343	M	28/09/18	401.1						2,318,334.17	1,398,610.59	0.00	-919,723.58	1.05
DK0060534915	NOVO NORDISK B	P	DKK	296.1678	M	28/09/18	302.4						2,597,032.38	2,648,331.96	0.00	51,299.58	1.98
DK0060542181	ISS	P	DKK	225.4892	M	28/09/18	226.						393,027.94	394,023.93	0.00	995.99	0.30
<b>DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>																	
BE0003739530	UCB	P	EUR	58.8343	M	28/09/18	77.4						882,514.96	1,161,000.00	0.00	278,485.04	0.87
BE0974259880	D'ETEREN DIVISION	P	EUR	41.8254	M	28/09/18	37.92						4,218,176.22	3,824,307.84	0.00	-393,868.38	2.87
DE0005089031	UTD INTERNET NOM.	P	EUR	42.2101	M	28/09/18	40.75						1,266,302.50	1,222,500.00	0.00	-43,802.50	0.92
DE0005545503	1AND1 DRILLI SCH	P	EUR	43.4937	M	28/09/18	41.9						3,044,561.70	2,933,000.00	0.00	-111,561.70	2.20
DE0005557508	DEUTSCHE TELEKOM	P	EUR	15.532	M	28/09/18	13.885						4,038,313.50	3,610,100.00	0.00	-428,213.50	2.70
DE0005565204	DUERR	P	EUR	36.5495	M	28/09/18	38.77						761,618.46	807,889.26	0.00	46,270.80	0.61
DE0005772206	FIELMANN	P	EUR	59.9608	M	28/09/18	51.85						3,403,854.62	2,943,420.80	0.00	-460,433.82	2.21
DE0006083405	HORNIBACH HOLDING	P	EUR	74.3282	M	28/09/18	60.4						668,953.50	543,600.00	0.00	-125,353.50	0.41
DE0008F80019	METRO	P	EUR	69.8792	M	28/09/18	54.35						1,327,495.77	1,032,486.95	0.00	-295,008.82	0.77
ES0105229001	PROSEGUR CASH	P	EUR	14.2344	M	28/09/18	13.5						1,281,093.00	1,215,000.00	0.00	-66,093.00	0.91
ES0113211835	BANCO BILBAO VIZC.	P	EUR	2.2882	M	28/09/18	1.888						1,830,580.00	1,510,400.00	0.00	-320,180.00	1.13
ES0161560018	NH HOTEL GROUP	P	EUR	7.2151	M	28/09/18	5.49						4,329,050.00	3,294,000.00	0.00	-1,035,050.00	2.47
ES0173093024	RED ELECTRICA	P	EUR	6.32	M	28/09/18	6.285						1,674,800.50	1,665,525.00	0.00	-9,275.50	1.25
ES0176252718	MELIA HOTELS INTL	P	EUR	18.2941	M	28/09/18	18.04						3,487,730.92	3,439,289.92	0.00	-48,441.00	2.58
FI0009014575	OUTTEC	P	EUR	16.9918	M	28/09/18	19.26						1,426,083.00	1,337,500.00	0.00	-88,583.00	1.00
FI4000062385	DNA PLC	P	EUR	82.9769	M	28/09/18	146.						1,933,100.00	1,928,000.00	0.00	-5,100.00	1.44
FR0000060071	SAMSE	P	EUR	18.	M	28/09/18	15.48						668,469.42	664,012.80	0.00	-4,456.62	0.50
FR0000075442	GROUPE LDIC	P	EUR	88.1305	M	28/09/18	113.3						1,359,342.00	1,540,800.00	0.00	181,458.00	1.15
FR000120073	AIR LIQUIDE	P	EUR	27.7002	M	28/09/18	26.18						1,714,385.42	3,016,506.00	0.00	1,302,120.58	2.26
FR000120560	NEOPOST	P	EUR	136.6591	M	28/09/18	112.5						4,705,661.87	4,447,406.04	0.00	-258,255.83	3.33
FR0004035913	ILIJAD	P	EUR	37.8984	M	28/09/18	42.						2,049,887.00	1,687,500.00	0.00	-362,387.00	1.26
FR0010386334	KORIAN	P	EUR	26.9582	M	28/09/18	31.36						7,104,250.83	7,873,110.00	0.00	768,859.17	5.90
FR0011191766	EOS IMAGING	P	EUR	5.8485	M	28/09/18	4.4						1,887,077.29	2,195,200.00	0.00	308,128.71	1.64
FR0012938884	SOLOCAL GROUP RGPT	P	EUR	1.6317	M	28/09/18	1.						2,011,980.82	1,513,674.80	0.00	-498,306.02	1.13
GB00B1YVCH82	THOMAS COOK GROUP	P	GBP	0.5972	M	28/09/18	0.579						10,461,357.43	6,411,237.00	0.00	-4,050,120.43	4.80
IT0003007728	TOD'S GROUP	P	EUR	67.5604	M	28/09/18	58.75						4,684,433.90	1,053,854.39	0.00	-24,678.46	0.79
IT0003697080	GEOX	P	EUR	2.9579	M	28/09/18	2.17						4,073,548.75	2,549,750.00	0.00	-610,885.15	3.05
NL0000090982	KONINKLIJKE KPN	P	EUR	2.3032	M	28/09/18	2.272						3,475,570.00	4,073,548.75	0.00	600,000.00	1.91
NL0011821202	ING GROEP	P	EUR	10.5947	M	28/09/18	11.184						1,381,935.00	1,363,200.00	0.00	-18,735.00	1.02
NL0011821392	PHILIPS LIGHTING	P	EUR	23.6166	M	28/09/18	22.3						320,277.23	338,092.32	0.00	17,815.09	0.25
US2267181046	CRITEO ADR	P	USD	38.4245	M	28/09/18	22.94						2,813,096.05	2,656,264.50	0.00	-156,831.55	1.99
<b>DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING</b>																	
GB0031274896	MARKS SPENCER GRP	P	GBP	3.6709	M	28/09/18	2.888						6,424,398.93	4,590,084.28	0.00	-1,834,314.65	3.44
GB00B1722W11	DART GROUP	P	GBP	5.2635	M	28/09/18	9.325						588,561.07	1,076,720.65	0.00	488,159.58	0.81

Stock : Stock admi principal au 28/09/18  
PORTEFEUILLE : F5264 TRUSTEAM ROC EUROPE

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 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
GB00B1KJ1408	WHITBREAD						10,461.	P GBP	38.8948	M 28/09/18	47.17		469,932.94	556,120.11	0.00	86,187.17	0.42
GB00B63QSB39	GREGGS						122,482.	P GBP	10.267	M 28/09/18	10.55		1,548,382.67	1,456,311.39	0.00	-92,071.28	1.09
GB00B1J62K685	PETS AT HOME GR						1,616,694.	P GBP	2.0937	M 28/09/18	1.194		4,240,642.15	2,175,512.95	0.00	-2,065,129.20	1.63
GB00BL1Y088	SAGA						630,504.	P GBP	2.0836	M 28/09/18	1.308		1,548,704.48	929,448.02	0.00	-619,256.46	0.70
DEVISE VALEUR : NOK COURONNE NORVEGIENNE																	
N00010063308	TELEOR						90,000.	P NOK	162.798	M 28/09/18	159.1		1,529,988.13	1,512,597.05	0.00	-17,391.08	1.13
N00010582521	GJENSID FORSIKR						30,000.	P NOK	138.608	M 28/09/18	137.2		434,539.46	434,796.39	0.00	256.93	0.33
N00010739402	SBANKEN						160,000.	P NOK	79.4585	M 28/09/18	88.7		1,350,928.95	1,499,181.32	0.00	148,252.37	1.12
DEVISE VALEUR : SEK COURONNE SUEDOISE																	
SE0000806994	JM						96,000.	P SEK	221.4216	M 28/09/18	174.5		2,192,711.75	1,624,987.87	0.00	-567,723.88	1.22
SE0007100599	SVENSKA HANDEL A						378,152.	P SEK	103.5521	M 28/09/18	112.25		4,027,818.04	4,117,524.69	0.00	89,706.65	3.09
Actions & valeurs ass. nég. sur un marché régl. ou ass. (sauf Warrants et Bons de Sous.)																	
CUMUL (EUR)																	
119,206,830.95																	
Actions & valeurs assimilées nég. sur un marché régl. ou assimilé																	
CUMUL (EUR)																	
119,206,830.95																	
Actions & valeurs assimilées																	
CUMUL (EUR)																	
119,206,830.95																	
Titres de créances																	
Titres de créances négociés sur un marché régl. ou assimilé																	
DEVISE VALEUR : EUR EURO																	
FR0124858525	ELIS	NCP03122018	NOL	999-03/12/18			1,000,000.	EUR	0.9971	31/08/18	-0.319	L	997,053.15	1,000,576.45	0.00	3,523.30	0.75
FR0124858509	ELIS	NCP01022019	NOL	999-01/02/19			2,000,000.	EUR	0.996	28/09/18	-0.30057	V	1,991,943.68	2,002,089.47	0.00	10,145.79	1.50
FR0125106569	ELIS	NCP02042019	NOL	999-02/04/19			1,000,000.	EUR	0.9982	28/09/18	-0.268	V	998,214.44	1,001,379.12	0.00	3,164.68	0.75
Titres de créances négociables																	
CUMUL (EUR)																	
3,987,211.27																	
Titres de créances négociés sur un marché régl. ou assimilé																	
CUMUL (EUR)																	
3,987,211.27																	
Titres de créances																	
CUMUL (EUR)																	
3,987,211.27																	
Titres d'OPC																	
OPCVIM Français à vocation générale/formule/indiciel/allégé/alternatif/ETF(trackers)																	
DEVISE VALEUR : EUR EURO																	
FR0007476734	MEYERB. TRESOR. C 3D						1,830.	P EUR	2056.1988	M 27/09/18	2045.51		3,762,843.87	3,743,283.30	0.00	-19,560.57	2.80
FR0010220038	TRUSTEAM ROC PME						1,500.	P EUR	133.9785	M 21/09/18	224.64		200,967.72	336,960.00	0.00	135,992.28	0.25
FR0010316216	TRUSTEAM OPT. B 3D						32,612.651	P EUR	161.8016	M 27/09/18	168.14		5,276,777.95	5,483,491.14	0.00	206,713.19	4.11
FR0010985804	TRUSTEAM ROC B 3D						3,000.	P EUR	193.09	M 27/09/18	430.74		579,270.00	1,292,220.00	0.00	712,950.00	0.97
FR0013263142	VAL. CR01S.RDMIV 4D						11,800.	P EUR	152.11	M 26/09/18	155.8		1,794,898.00	1,838,440.00	0.00	43,542.00	1.38
FR0013278769	TRUSTEAM ROC L/S B						2,510.	P EUR	199.49	M 21/09/18	200.11		500,719.90	502,276.10	0.00	1,556.20	0.38

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/09/18  
 PORTEFEUILLE : F5264 TRUSTEAM ROC EUROPE

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
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>																	
OPCVM Français à vocation générale/formule/indiciel/allégé/alternatif/ETF(trackers)																	
<b>Titres d'OPC</b>																	
<b>PORTEFEUILLE TITRES</b>																	
<b>TRESORERIE</b>																	
<b>Dettes et créances</b>																	
<b>SRD et règlements différés</b>																	
DEVISE VALEUR : EUR EURO																	
AT01.EUR						Ach.titr rgt.différé	-1,344,806.86	EUR	1		1		-1,344,806.86	-1,344,806.86	0.00	0.00	-1.01
VT01.EUR						Vt.titr.rég.différé	1,142,412.6	EUR	1		1		1,142,412.60	1,142,412.60	0.00	0.00	0.86
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>																	
DEVISE VALEUR : NOK COURONNE NORVEGIENNE																	
AT01.NOK						Ach.titr rgt.différé	-6,474,135.75	NOK	0.10475043		0.10563566		-678,168.52	-683,899.62	0.00	-5,731.10	-0.51
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : NOK COURONNE NORVEGIENNE</b>																	
<b>SRD et règlements différés</b>																	
Coupons et dividendes																	
DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING																	
GB00B172W11 DART GROUP							102,453.	P GBP	0.06	28/09/18	0.		6,927.96	6,927.96	0.00	6.47	0.01
GB00B630S839 GREGGS							122,482.	P GBP	0.10699997	28/09/18	0.		14,770.17	14,770.17	0.00	261.30	0.01
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING</b>																	
DEVISE VALEUR : NOK COURONNE NORVEGIENNE																	
M00010063308 TELENOR							50,000.	P NOK	3.3	28/09/18	0.		17,429.88	17,429.88	0.00	221.77	0.01
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : NOK COURONNE NORVEGIENNE</b>																	
<b>SRD et règlements différés</b>																	
Coupons et dividendes																	
DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING																	
GB00B172W11 DART GROUP							102,453.	P GBP	0.06	28/09/18	0.		6,927.96	6,927.96	0.00	6.47	0.01
GB00B630S839 GREGGS							122,482.	P GBP	0.10699997	28/09/18	0.		14,770.17	14,770.17	0.00	261.30	0.01
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING</b>																	
DEVISE VALEUR : NOK COURONNE NORVEGIENNE																	
M00010063308 TELENOR							50,000.	P NOK	3.3	28/09/18	0.		17,429.88	17,429.88	0.00	221.77	0.01
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : NOK COURONNE NORVEGIENNE</b>																	



Stock : Stock admi principal au 28/09/18  
PORTEFEUILLE : F5264 TRUSTEAM ROC EUROPE

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
<b>Coupons et dividendes</b>																	
<b>Frais de gestion</b>																	
<i>Frais de gestion</i>																	
DEVISE VALEUR : EUR EURO																	
FGES	EUR				1.		-172,128.83				1.		-172,128.83		0.00	0.00	-0.13
<i>Prov frais gestion</i>																	
<i>Frais de gestion</i>																	
<b>Frais de gestion</b>																	
<b>Dettes et créances</b>																	
<b>Disponibilités</b>																	
<b>Comptes à vue</b>																	
DEVISE VALEUR : EUR EURO																	
BQ01	EUR	Banque			1.		8,991,924.65				1.		8,991,924.65		-3,134.63	-3,134.63	6.73
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</b>																	
<b>DEVISE VALEUR : NOK COUROSSE NORVEGIENNE</b>																	
BQ01	NOK	Banque			0.10556318		6,474,135.75				0.10556318		683,430.35		-3,134.63	-3,134.63	6.73
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : NOK COUROSSE NORVEGIENNE</b>																	
<b>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</b>																	
BQ01	USD	Banque			0.92183206		732,804.64				0.92183206		683,430.35		0.00	0.00	0.51
<b>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</b>																	
<b>Comptes à vue</b>																	
<b>Disponibilités</b>																	
<b>TRESORERIE</b>																	
												10,350,877.81		-3,134.63	-45,150.30	7.72	
												10,350,877.81		-3,134.63	-45,150.30	7.72	
												9,336,824.67		-3,134.63	-50,391.86	6.96	
<b>PORTFEUILLE : TRUSTEAM ROC EUROPE (F5264)</b>												144,646,344.33		-3,134.63	-11,178,204.06	100.00	



Stock : Stock admi principal au 28/09/18  
PORTEFEUILLE : F5264 TRUSTEAM ROC EUROPE

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

VL VALIDEE  
Devise de fixing : FXF Dev. BCE 14H  
Devise du portefeuille : EUR  
(Etat simplifie, trame : CLASST COB COMPLET(TL1), Tris : BVAL)

Portefeuille titres : 124,181,707.46 Coupons et dividendes a recevoir : 39,128.01

Frais de gestion du jour

C1 Prov frais gestion : 5,032.86 EUR  
C2 Prov frais gestion : 1,166.92 EUR

Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coeff. actif	Coeff. passif	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
C1	EUR	91,179,323.90	440,237.789	207.11	68.316019939431			207.11	207.11
C2	EUR	42,288,816.37	195,287.095	216.55	31.683980060569			216.55	216.55
		Actif net total en EUR :	133,468,140.27						

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 : 13.95 Statut DD : I  
Poids DI : 22. Statut DI : 0



Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/09/18  
 PORTEFEUILLE : F5264 TRUSTEAM ROC EUROPE

VL VALIDEE

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

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

COURS DES DEVISES 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	
Cours EUR en GBP :	0.8873	cotation :	28/09/18	0.	0.88973	-0.0362
Cours EUR en NOK :	9.4665	cotation :	28/09/18	0.	9.5015	-0.27312
Cours EUR en SEK :	10.309	cotation :	28/09/18	0.	10.3208	-0.36836
Cours EUR en USD :	1.1576	cotation :	28/09/18	0.	1.1707	-0.11433
						-1.11899

Equity fund - Poids calcule de 82.18 % (pour un seuil de 51. %)

