



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 L/S*  
**Attestation du commissaire aux comptes**  
**sur la composition de l'actif au 29 juin 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 L/S**

10, rue de Lincoln - 75008 Paris

**Attestation du commissaire aux comptes**  
**sur la composition de l'actif au 29 juin 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 29 juin 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 10 août 2018

KPMG S.A.

Gérard Gaultry  
Associé

OPCVM : PA6695 - TRUSTEAM ROC LONG SHORT

Actif net : 2 196 639,87

Devise de Référence : EUR

Code Valeur	Libellé Valeur	Code Place Cot.	Date Ech.	Quantité Nominale	Prix de Revient Unitaire	Prix de Revient Global	Cours / Taux	Date Cours	Dev. Cot.	Valeur Boursière	+/- Value potentielle / Prime	Validation définitive	
												Intérêts / Coupon Couru	% Actif Net
<b>OBLIGATIONS</b>													
DE000B83CF0	COMZBK 7.75% 11-16.03.21/SUB	186	16/03/21	100 000,000000	118,1300	118 130,00	117,1644	29/06/18	EUR	119 478,79	-965,59	2 314,38	5,44
<b>TOTAL OBLIGATIONS</b>													
						118 130,00				119 478,79	-965,59	2 314,38	5,44
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>													
						118 130,00				119 478,79	-965,59	2 314,38	5,44
<b>TCN TREASURY BILLS (Précomptés)</b>													
ES010181162	SPAIN 0% 17-16.11.18	552	16/11/18	500 000,000000	100,2085	501 042,34	100,2111	29/06/18	EUR	501 055,70	13,36	0,00	22,81
<b>TOTAL TCN TREASURY BILLS (Précomptés)</b>													
						501 042,34				501 055,70	13,36	0,00	22,81
<b>TOTAL ESPAGNE</b>													
						501 042,34				501 055,70	13,36	0,00	22,81
<b>OBLIGATIONS</b>													
FI4000251756	FINNAIR OYJ 2.25% 17-29.03.22	018	29/03/22	100 000,000000	103,7800	103 780,00	103,5016	29/06/18	EUR	104 093,33	-278,45	591,78	4,74
<b>TOTAL OBLIGATIONS</b>													
						103 780,00				104 093,33	-278,45	591,78	4,74
<b>TOTAL FINLANDE</b>													
						103 780,00				104 093,33	-278,45	591,78	4,74
<b>OBLIGATIONS</b>													
FR0013331188	ILIAD 0.625% 18-25.11.21	047	25/11/21	100 000,000000	98,8310	98 831,00	99,2091	29/06/18	EUR	99 327,25	378,10	118,15	4,52
FR0011993120	NEOPOST 2.5% 14-23.06.21	025	23/06/21	100 000,000000	102,9900	102 990,00	102,4732	29/06/18	EUR	102 541,73	-516,76	88,49	4,67
FR0010383901	RADIAN 4.05% 06-13.11.18	025	13/11/18	100 000,000000	101,7400	101 740,00	100,9222	29/06/18	EUR	103 496,45	-817,80	2 574,25	4,71
<b>TOTAL OBLIGATIONS</b>													
						303 561,00				305 365,43	-956,46	2 760,89	13,90
<b>OPCVM Français à vocation générale</b>													
FR0007476734	MEYERBEER TRESOR-C-DE CAP	260		107,000000	2 047,4700	219 079,29	2 047,1900	27/06/18	EUR	219 049,33	-29,96	0,00	9,97
<b>TOTAL OPCVM Français à vocation générale</b>													
						219 079,29				219 049,33	-29,96	0,00	9,97
<b>TCN ECP (Précomptés)</b>													
FR0125044620	IPSEN 0% 18-09.06.18 CP	989	06/09/18	500 000,000000	100,0399	500 199,45	100,0312	29/06/18	EUR	500 155,89	-43,56	0,00	22,77
<b>TOTAL TCN ECP (Précomptés)</b>													
						500 199,45				500 155,89	-43,56	0,00	22,77
<b>TOTAL FRANCE</b>													
						1 022 839,74				1 024 570,65	-1 029,98	2 760,89	46,64
<b>OBLIGATIONS</b>													
XS0611398008	BARCLAYS 6.625% 11-30.03.2022	361	30/03/22	100 000,000000	120,2500	120 250,00	118,0495	29/06/18	EUR	119 773,82	-2 200,50	1 724,32	5,45
XS1204272709	MERLIN ENTMTS 2.75% 15.03.22	047	15/03/22	100 000,000000	103,2000	103 200,00	103,3720	29/06/18	EUR	104 197,00	172,00	825,00	4,74
<b>TOTAL OBLIGATIONS</b>													
						223 450,00				223 970,82	-2 028,50	2 549,32	10,20
<b>TOTAL GRANDE-BRETAGNE</b>													
						223 450,00				223 970,82	-2 028,50	2 549,32	10,20

OPCYM : PA6685 - TRUSTEAM ROC LONG SHORT

Actif net : 2 196 639,87

Devise de Référence : EUR

Code Valeur	Libellé Valeur	Code Place Cot.	Date Ech.	Quantité Nominale	Prix de Revient Unitaire	Prix de Revient Global	Cours / Taux	Date Cours	Dev. Cot.	Valeur Boursière	+/- Value potentielle / Pft / %	Validation définitive		
												Intérêts / Coupon Cours	% Actif Net	
XS1028954853	BHARTI AIRT 3.375% 14-20.05.21	186	20/05/21	100 000,000000	107,0000	107 000,00	105,6605	29/06/18	EUR	106 067,35	-1 339,50	406,85	4,83	
TOTAL OBLIGATIONS											106 067,35	-1 339,50	406,85	4,83
TOTAL PAYS-BAS											106 067,35	-1 339,50	406,85	4,83
TOTAL TRUSTEAM ROC LONG SHORT - VL DU 29/06/2018											2 076 242,08	-5 628,66	8 623,22	94,66



OPCVM : PA6695 - TRUSTEAM ROC LONG SHORT

Actif net : 2 196 639,87

Devise de Référence : EUR

	Montant	%
--	---------	---

OBLIGATIONS	119 478,79	5,44 %
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>	<b>119 478,79</b>	<b>5,44 %</b>

TCN TREASURY BILLS (Précomptés)	501 055,70	22,81 %
<b>TOTAL ESPAGNE</b>	<b>501 055,70</b>	<b>22,81 %</b>

OBLIGATIONS	104 093,33	4,74 %
<b>TOTAL FINLANDE</b>	<b>104 093,33</b>	<b>4,74 %</b>

OBLIGATIONS	305 365,43	13,90 %
-------------	------------	---------

OPCVM Français à vocation générale	219 049,33	9,97 %
------------------------------------	------------	--------

TCN ECP (Précomptés)	500 155,89	22,77 %
<b>TOTAL FRANCE</b>	<b>1 024 570,65</b>	<b>46,64 %</b>

OBLIGATIONS	223 970,82	10,20 %
<b>TOTAL GRANDE-BRETAGNE</b>	<b>223 970,82</b>	<b>10,20 %</b>

OBLIGATIONS	106 067,35	4,83 %
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>	<b>106 067,35</b>	<b>4,83 %</b>

<b>TOTAL PORTEFEUILLE</b>	<b>2 079 236,64</b>	<b>94,66 %</b>
---------------------------	---------------------	----------------

OPCVM : PA6695 - TRUSTEAM ROC LONG SHORT Actif net : 2 196 639,87 Devise de Référence : EUR

	Montant	%
DISPONIBILITES	117 403,23	5,34 %
TOTAL ACTIF NET	2 196 639,87	100,00 %

Classe	Type de part	VL	Devise VL	Nb de Parts	Actif Net
AC	R	199,69	EUR	2 000	399 388,53
BC	R	199,69	EUR	6 250	1 248 091,27
IC	R	199,69	EUR	2 750	549 160,07
Total Actif Net Portefeuille					2 196 639,87



OPCVM : PA6685 - TRUSTEAM ROC LONG SHORT

Actif net : 2 196 639,87

Devise de Référence : EUR

Disponibilités	
Libellé Compte	Montant
Comptes à vue - EUR	117 403,23
	5,34 %
<b>Total</b>	<b>117 403,23</b>
	<b>5,34 %</b>

EURO 1,0000000

