



EUROSE

DOCUMENT D'INFORMATION PERIODICITE SEMESTRIELLE AU 28/06/2019

FORME JURIDIQUE DE L'OPCVM

FCP de droit français relevant de la Directive 2009/65/CE

AFFECTATION DES SOMMES DISTRIBUABLES

Intégralement capitalisées

1 DNCA Investments est une marque commerciale de DNCA Finance

GESTIONNAIRE ET PROMOTEUR

DNCA FINANCE

19, Place Vendôme – 75001 Paris

DEPOSITAIRE

CREDIT INDUSTRIEL ET COMMERCIAL (CIC)

6, avenue de Provence – 75009 Paris

ORIENTATION

Dans le cadre d'une gestion discrétionnaire, visant une faible volatilité de la valeur liquidative, le FCP est investi indifféremment en actions, obligations et produits monétaires en adaptant le programme d'investissement en fonction de la conjoncture et des anticipations du gérant. L'exposition totale au risque action peut aller jusqu'à 35% de l'actif et jusqu'à 100% en produits de taux. La gestion cherche à tirer parti au mieux des mouvements sur les titres.

La gestion actions privilégie les actions décotées ou les actions de rendement libellées en euro. Le portefeuille actions peut être concentré sur les secteurs jugés les plus décotés. Pour la part investie en obligations et titres de créance à taux fixe, l'objectif de gestion patrimoniale du FCP le conduit à se porter essentiellement sur des échéances moyennes, c'est-à-dire inférieures à sept ans.

Les investissements réalisés en titres à taux variable – coupons révisés en fonction de l'évolution des taux ou indexés sur l'inflation – échappent en grande partie au risque de hausse du niveau général des taux et peuvent présenter des maturités plus élevées.

Les titres sélectionnés appartiennent en grande majorité à la catégorie « Investissement Grade » telle que définie par les agences de notation internationales. Des achats de titres d'émetteurs classés hors de cette catégorie ou n'ayant pas fait l'objet d'une notation sont possibles.

Le gérant choisit d'investir dans des obligations convertibles ou échangeables en actions lorsque cette alternative lui semble techniquement judicieuse par rapport à l'achat en direct de l'action sous-jacente. La sélection du titre respecte les critères de maturité et de solvabilité énoncés ci-dessus ou, lorsque la rémunération offerte est proche de celle d'une obligation du même émetteur.

Le Fonds ne peut investir que dans des titres libellés en Euro. Toutefois, dans le cadre d'investissement en parts et/ou actions d'OPC détenant des titres libellés en devise, le Fonds peut être exposé indirectement au risque de change et de façon marginale.

Le Fonds pourra également détenir de façon marginale des titres libellés dans une autre devise que l'Euro dans le cadre d'opération sur titres (exemples : détachement de dividende, exercice de droits, échanges de titres). Les titres libellés dans une autre devise que l'Euro auront vocation à être cédés dans les meilleurs délais en tenant compte de l'intérêt des porteurs.

Le fonds ne peut investir en direct que dans des titres de pays de l'OCDE. Toutefois, dans le cadre d'investissement en parts et/ou actions d'OPC détenant des titres hors OCDE, le fonds peut être exposé de façon marginale à un risque de pays hors OCDE.

Obligations et Titres de créances négociables : Le FCP peut être exposé dans une fourchette de 0 à 100% de l'actif net à l'ensemble des catégories de produit de taux libellés en euros (obligations, titres de créances négociables, etc.) de toute notation ou non notés dont au moins 50% en titres de créance de la catégorie « *Investment Grade* » (c'est-à-dire de notation supérieure ou égale à A-3 pour le court terme ou BBB- pour le long terme selon l'échelle Standard & Poor's par exemple ou jugée

équivalente par la société de gestion). Etant précisé que la société de gestion ne recourt pas systématiquement pour fonder ses décisions d'investissement à des notations émises par des agences de notation et pourra procéder à sa propre analyse.

Obligations : le FCP s'autorise à investir sur l'ensemble des catégories d'obligations, du secteur public ou du secteur privé selon les opportunités de marché, notamment :

- des emprunts émis ou garantis par un Etat membre de l'OCDE, par les collectivités territoriales d'un Etat membre de l'Union Européenne ou partie à l'accord sur l'Espace économique européen, ou par un organisme international à caractère public dont un ou plusieurs Etats membres de l'Union Européenne ou partie à l'accord sur l'Espace économique européen font partie, ou de titres émis par la CADES, d'échéance moyenne.

- des obligations foncières,
- des emprunts du secteur public ou semi-public,
- des emprunts du secteur privé

Titres de créances négociables : Titres négociables à court terme (anciennement certificats de dépôt et billets de trésorerie).

Actions :

Le FCP investit dans une fourchette de 0 à 35% de l'actif net en actions de sociétés de toute capitalisation, libellées en euros ayant leur siège social dans un pays de l'OCDE et sélectionnées en fonction de leur valorisation boursière (PER), leurs publications de résultats et leur positionnement sectoriel.

Le fonds pourra également recourir à des actions de sociétés dont la capitalisation est inférieure à 1 milliard d'euros dans la limite de 5% de l'actif net.

Actions ou parts d'autres OPC :

Le FCP peut détenir, dans limite de 10% de son actif net, des parts ou actions d'OPCVM français ou européens relevant de la directive 2009/65/CE et/ou des parts ou actions de Fonds d'Investissement à Vocation Générale destinés à des investisseurs non professionnels relevant de la Directive 2009/61/UE et répondant aux critères de l'article R.214-13 du code monétaire et financier. Ces OPC peuvent être gérés par DNCA Finance.

Les instruments financiers dérivés :

Néant

Les titres intégrant des dérivés

Ce fonds peut investir jusqu'à 100% de son actif en obligations convertibles. Il peut également détenir des bons ou droits de souscription d'actions ou d'obligations.

Nature des marchés d'intervention : le FCP peut intervenir dans des titres intégrant des dérivés sur des marchés réglementés français et étrangers ou de gré à gré simple.

Risques sur lesquels le gérant désire intervenir : risque action, risque de taux.

Nature des interventions : le gérant peut prendre des positions, titres intégrant des dérivés utilisés à titre de couverture et/ou d'exposition au risque action et/ou risque de taux, sans recherche de surexposition du portefeuille.

Nature des instruments utilisés : obligations convertibles, bons ou droits de souscription d'actions ou d'obligations, EMTN simples, warrants, certificats cotés sur les marchés réglementés ou négociés de gré à gré avec les émetteurs.

Dépôts:

Le FCP pourra utiliser les dépôts dans la limite de 20% de son actif auprès d'un même établissement de crédit pour garantir une liquidité aux actionnaires et pour pouvoir profiter des opportunités de marché.

Emprunts d'espèces:

Les emprunts en espèces ne peuvent représenter plus de 10% de l'actif et servent, de façon ponctuelle, à assurer une liquidité aux porteurs désirant racheter leurs actions sans pénaliser la gestion globale des actifs.

Acquisition et cession temporaire de titres:

Néant

Gestion des garanties financières :

Néant.

DUREE MINIMALE DE PLACEMENT RECOMMANDEE

Supérieure à 3 ans.

CHANGEMENTS INTERVENUS AU COURS DU SEMESTRE

- Possibilité de souscrire en montant et en parts.
- Insertion du tableau des modalités de souscriptions/rachats conformément à l'instruction AMF 2011-19
- Abaissement des droits d'entrée maximum de 3% à 1%

CHANGEMENTS A VENIR

Néant.

POLITIQUE DE GESTION

Avec la trêve dans la guerre commerciale et technologique opposant Chine et États-Unis, le semestre se termine sur une note plutôt positive. Mais le réel principal moteur derrière la bonne performance des marchés sur ces six derniers mois reste le retour du biais – très – accommodant des principales banques centrales, la Réserve fédérale des Etats-Unis (FED) et la Banque centrale européenne (BCE) en tête. Le mois de juin aura même vu une amplification de ce positionnement, avec des discours d'officiels et des discussions de marché autour de possibles baisses des taux directeurs dans les prochains mois, de part et d'autre de l'Atlantique. En conséquence, les taux souverains en zone Euro baissent encore ; la France, pour la première fois de son histoire, voit son taux d'emprunt à 10 ans entrer en territoire négatif. Dans cet univers où le moindre rendement est difficile à trouver, le crédit a les faveurs du marché : les *spreads* se sont fortement resserrés. Les actions, actif risqué par excellence, en profitent également : l'Euro STOXX 50 Net Return réalise un gain de près de 20% depuis le début d'année.

Sur le premier semestre 2019, la performance d'EUROSE s'établit à :

- Part C : +4,15% ;
- Part N : +4,41% ;
- Part S : +4,77%

contre +8,40 % pour son indice composite (20% EURO STOXX 50 + 80% FTSE MTS Global calculé dividendes et coupons réinvestis).

Les performances passées ne présagent en rien les performances futures.

Depuis le début de l'année, parmi les actions, les trois meilleures performances ont été réalisées par SOLOCAL GROUP, CECONOMY AG, ASM INTERNATIONAL NV. À l'inverse les actions EDF, TECHNICOLOR et SOCIETE GENERALE ont été les trois plus faibles.

Parmi les principaux mouvements opérés depuis le début de l'année, on peut noter les renforcements en PUBLICIS, SOCIETE GENERALE et BOUYGUES. À l'inverse les actions NOKIA et VIVENDI ont été allégées et les titres GEMALTO ont été apportés à l'offre publique d'achat (OPA) lancée par THALES.

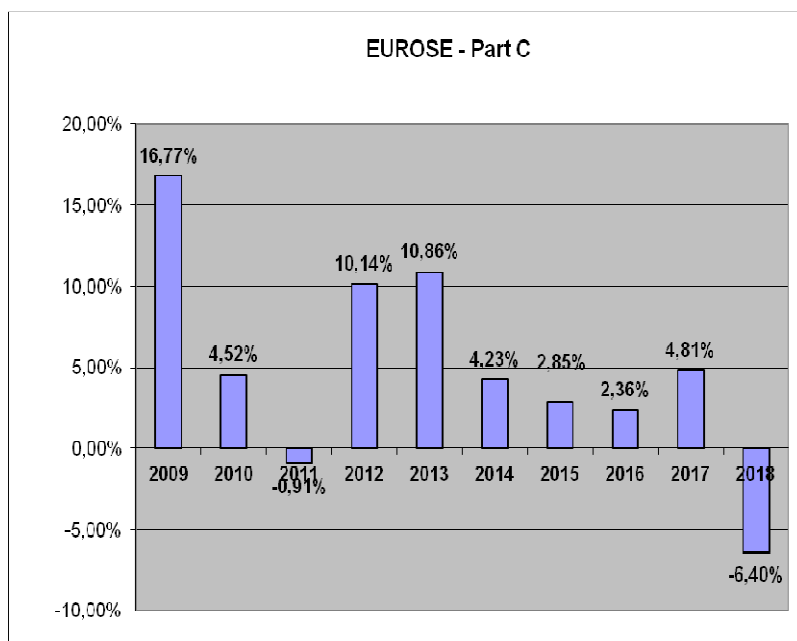
Le niveau des liquidités dans le portefeuille (y compris les OPCVM monétaires et fonds assimilés) s'établit à +4,45% en fin de période et son actif net atteint 4 066 millions d'euros.

Les perspectives pour le second semestre 2019 :

Rappelons que la forte performance du premier semestre de l'année en cours intervient après la chute des marchés en fin d'année dernière. Nos convictions restent les mêmes, en termes de choix d'allocation mais encore plus en termes de sélections de titres. Le marché a aujourd'hui totalement mis de côté le risque de remontée des taux d'intérêt, ne serait-ce qu'un retour à 0% du taux à 10 ans allemand. Une majorité d'investisseurs est ainsi prête à prendre d'importants risques de duration. En témoigne par exemple l'émission en fin de mois par la société Unibail-Rodamco-Westfield, leader européen de l'immobilier commercial, d'une obligation de 500 millions d'euros, d'échéance 2049, à un rendement annuel de 1,83%. Nous ne souhaitons pas prendre ce risque et conservons une faible sensibilité aux taux d'intérêt. Par ailleurs, plusieurs opérations d'acquisitions de sociétés en zone Euro (Altran, Ramirent, Latécoère) sont la preuve qu'il y a de la valeur dans les actions (dé)cotées aujourd'hui.

PERFORMANCES

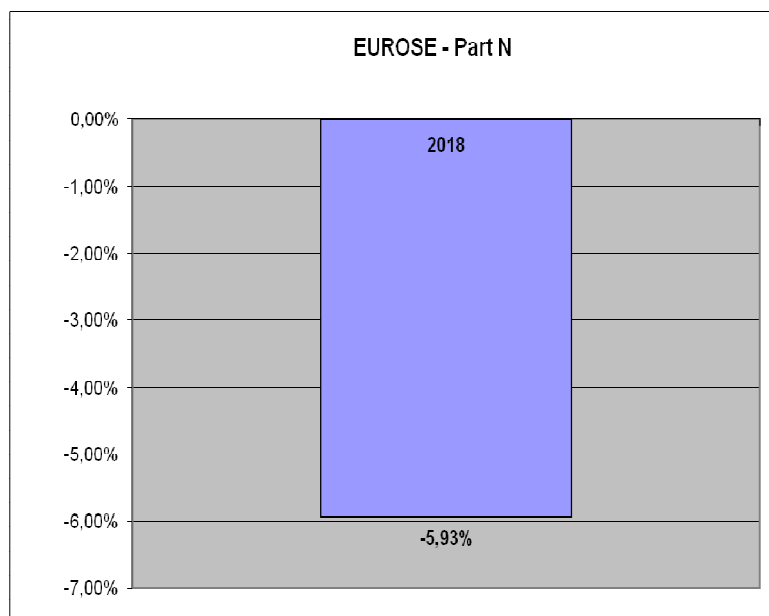
Performance de la part C du FCP EUROSE depuis 2009 sur les années civiles :



Performances annualisées	1 an	3 ans	5 ans
EUROSE – Part C	-6,40%	+0,14%	+1,49%
Indice composite calculé dividendes et coupons réinvestis*	-1,76%	+1,34%	+3,67%

* : 20% EURO STOXX 50 + 80% FTSE MTS Global calculé dividendes et coupons réinvestis

Performance de la part N du FCP EUROSE depuis 2018 sur les années civiles :



Performances annualisées	1 an	3 ans	5 ans
EUROSE – Part N	-5,93%	N/A	N/A
Indice composite calculé dividendes et coupons réinvestis*	-1,76%	N/A	N/A

* : 20% EURO STOXX 50 + 80% FTSE MTS Global calculé dividendes et coupons réinvestis

La part « S » ayant été lancée au cours de l'année 2018, il existe trop peu de données pour présenter une performance annualisée.

Les performances passées ne présagent en rien les performances futures. Les données de performance ne tiennent pas compte des commissions et frais perçus lors de l'émission et du rachat des parts.

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	3 692 130 529,72
b) Avoirs bancaires	0,00
c) Autres actifs détenus par l'OPCVM	403 013 970,71
d) Total des actifs détenus par l'OPCVM	4 095 144 500,43
e) Passif	-29 073 356,33
f) Valeur nette d'inventaire	4 066 071 144,10

* Les montants sont signés

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

Part	Type de part	Actif net	Nombre de parts en circulation	Valeur liquidative
C1 EUROSE FCP 4DEC	Capitalisable	3 971 756 369,62	10 614 250,1569	374,19
C2 EUROSE S FCP 4DEC	Capitalisable	3 882 920,53	38 965,4217	99,65
L1 EUROSE N FCP 4DEC	Capitalisable	90 431 853,95	239 811,76	377,09

ELEMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres :	Pourcentage
	Actif net
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	90,80
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

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	0,00
d) Les titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier	0,00
e) Les autres actifs	8,98

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
FRANCE	44,15
ITALIE	18,43
PAYS-BAS	7,03
AUTRES PAYS	21,00
TOTAL	90,61

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	953 778 150,19
Cessions	1 337 650 220,59

REGLEMENT 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 à communiquer aux investisseurs à ce titre.

Les prospectus, Documents d'Informations Clés pour l'Investisseur, règlement du FCP, rapports annuel et semestriel sont disponibles sur le site internet de la société <http://www.dnca-investments.com> et peuvent être adressés gratuitement sur simple demande auprès de DNCA FINANCE – 19 Place Vendôme - 75001 Paris ou auprès de ses Représentants :

- En Suisse :
CARNEGIE FUND SERVICES S.A. – 11, rue du Général - Dufour – 1204 Genève

- Au Luxembourg :
BNP Paribas Securities Services – 60 avenue J.F. Kennedy L-1855 Luxembourg

COMPOSITION DETAILLEE DU PORTEFEUILLE AU 28 juin 2019 (ci-après)

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/19

PORTEFEUILLE : F5016 EUROSE

Devise de fixing : FXE Dev. Bloomberg 18 h

VALIDATION PARTIELLE Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : CLASSEMENT ALPHABETIQUE SUR LIBVAL TTES DEV.CONF., Tris

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	Devise du portefeuille			PRCT ACT NET	
								<-----> PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA		-----> PLUS OU MOINS VAL
PORTEFEUILLE TITRES												
Actions & valeurs assimilées												
Actions & valeurs ass. nég. sur un marché régl. ou ass.(sauf Warrants et Bons de Sous.)												
FR0000031122	AIR FRANCE-KLM	4,950,000.	P EUR	9.6486	M 28/06/19	8.452		47,760,735.37	41,837,400.00	0.00	-5,923,335.37	1.03
FR0000053951	AIR LIQUIDE PRIME	181,500.	P EUR	84.9048	M 28/06/19	123.05		15,410,225.97	22,333,575.00	0.00	6,923,349.03	0.55
FR0000120073	AIR LIQUIDE	18,500.	P EUR	115.9059	M 28/06/19	123.05		2,144,259.15	2,276,425.00	0.00	132,165.85	0.06
FR0000034639	ALTRAN TECHN.	880,000.	P EUR	13.9368	M 28/06/19	13.955		12,264,387.52	12,280,400.00	0.00	16,012.48	0.30
NL0000334118	ASM INTERNATIONAL	130,000.	P EUR	43.308	M 28/06/19	57.26		5,630,037.97	7,443,800.00	0.00	1,813,762.03	0.18
FR0000120503	BOUYGUES	1,940,000.	P EUR	28.6082	M 28/06/19	32.57		55,499,823.92	63,185,800.00	0.00	7,685,976.08	1.55
FR0000120172	CARREFOUR	1,300,000.	P EUR	21.6578	M 28/06/19	16.98		28,155,199.76	22,074,000.00	0.00	-6,081,199.76	0.54
DE0007257503	CECONOMY	2,000,000.	P EUR	11.8169	M 28/06/19	5.394		23,633,838.39	10,788,000.00	0.00	-12,845,838.39	0.27
FR0013181864	CGG RGPT	9,700,000.	P EUR	3.6776	M 28/06/19	1.6525		35,672,610.12	16,029,250.00	0.00	-19,643,360.12	0.39
FR0010667147	COFACE	950,000.	P EUR	9.8566	M 28/06/19	8.87		9,363,733.77	8,426,500.00	0.00	-937,233.77	0.21
NL0010583399	CORBION	440,000.	P EUR	27.1203	M 28/06/19	28.64		11,932,942.00	12,601,600.00	0.00	668,658.00	0.31
FR0000045072	CREDIT AGRICOLE	4,830,000.	P EUR	11.9316	M 28/06/19	10.545		57,629,783.22	50,932,350.00	0.00	-6,697,433.22	1.25
DE0007100000	DAIMLER	480,000.	P EUR	62.8808	M 28/06/19	48.925		30,182,790.16	23,484,000.00	0.00	-6,698,790.16	0.58
FR0000121725	DASSAULT AVIATION	22,000.	P EUR	1060.146	M 28/06/19	1264.		23,323,212.83	27,808,000.00	0.00	4,484,787.17	0.68
DE000DWS1007	DWS GROUP GMBH+CO.	250,000.	P EUR	31.5246	M 28/06/19	30.78		7,881,159.57	7,695,000.00	0.00	-186,159.57	0.19
FR0010242511	EDF	450,000.	P EUR	11.8352	M 28/06/19	11.085		5,325,821.80	4,988,250.00	0.00	-337,571.80	0.12
FR0013295284	EDF PRIME 2020	3,000,000.	P EUR	8.2794	M 28/06/19	11.085		24,838,104.49	33,255,000.00	0.00	8,416,895.51	0.82
FR0011635515	EDF PRIME DE FIDEL	1,300,000.	P EUR	19.5828	M 28/06/19	11.085		25,457,704.05	14,410,500.00	0.00	-11,047,204.05	0.35
LU0011904405	ESPIRITO SANTO	1,730,000.	P EUR	5.2335	M 22/07/16	0.	V	9,053,981.69	0.00	0.00	-9,053,981.69	0.00
FR0010533075	GETLINK SE	2,000,000.	P EUR	8.6819	M 28/06/19	14.09		17,363,850.88	28,180,000.00	0.00	10,816,149.12	0.69
IT0000072618	INTESA SANPAOLO	10,200,000.	P EUR	2.1625	M 28/06/19	1.882		22,057,843.20	19,196,400.00	0.00	-2,861,443.20	0.47
FR0000130213	LAGARDERE	880,000.	P EUR	24.5361	M 28/06/19	22.9		21,591,795.47	20,152,000.00	0.00	-1,439,795.47	0.50
IT0003856405	LEONARDO	2,070,000.	P EUR	5.1722	M 28/06/19	11.145		10,706,380.87	23,070,150.00	0.00	12,363,769.13	0.57
FR0000121261	MICHELIN	575,000.	P EUR	73.0189	M 28/06/19	111.55		41,985,884.36	64,141,250.00	0.00	22,155,365.64	1.58
FI0009000681	NOKIA	740,000.	P EUR	4.8798	M 28/06/19	4.366		3,611,067.03	3,230,840.00	0.00	-380,227.03	0.08
FR0000133308	ORANGE	6,100,000.	P EUR	13.0514	M 28/06/19	13.865		79,613,594.74	84,576,500.00	0.00	4,962,905.26	2.08
FR0000130577	PUBLICIS GROUPE	540,000.	P EUR	47.9092	M 28/06/19	46.43		25,870,990.74	25,072,200.00	0.00	-798,790.74	0.62
GB00B03MLX29	ROYAL DUTCH SHEL.A	840,000.	P EUR	26.2184	M 28/06/19	28.71		22,023,443.18	24,116,400.00	0.00	2,092,956.82	0.59
FR0000120578	SANOFI	1,080,000.	P EUR	68.7828	M 28/06/19	75.91		74,285,414.68	81,982,800.00	0.00	7,697,385.32	2.02
FR0000130809	SOCIETE GENERALE	2,260,000.	P EUR	33.0045	M 28/06/19	22.22		74,590,102.23	50,217,200.00	0.00	-24,372,902.23	1.24
FR0012938884	SOLOCAL GROUP RGPT	6,400,000.	P EUR	1.1051	M 28/06/19	0.905		7,072,800.52	5,792,000.00	0.00	-1,280,800.52	0.14
NL0000226223	STMI CROELECTRONICS	4,622,000.	P EUR	7.9463	M 28/06/19	15.6		36,727,681.24	72,103,200.00	0.00	35,375,518.76	1.77
FR0010918292	TECHNI COLOR RGPT	1,300,000.	P EUR	5.3586	M 28/06/19	0.814		6,966,127.59	1,058,200.00	0.00	-5,907,927.59	0.03
IT0003497176	TELECOM ITAL. EPAR.	44,500,000.	P EUR	0.9311	M 28/06/19	0.4561		41,432,016.00	20,296,450.00	0.00	-21,135,566.00	0.50
FR0000121329	THALES	700,000.	P EUR	37.9184	M 28/06/19	108.65		26,542,887.38	76,055,000.00	0.00	49,512,112.62	1.87
FR0000120271	TOTAL	1,760,000.	P EUR	43.7751	M 28/06/19	49.275		77,044,262.13	86,724,000.00	0.00	9,679,737.87	2.13
DE000TUAG000	TUI NOM.	350,000.	P EUR	8.6826	M 28/06/19	8.604		3,038,917.00	3,011,400.00	0.00	-27,517.00	0.07
FR0000125486	VINCI	630,000.	P EUR	45.7648	M 28/06/19	90.06		28,831,794.70	56,737,800.00	0.00	27,906,005.30	1.40
FR0000127771	VIVENDI	780,000.	P EUR	17.6263	M 28/06/19	24.21		13,748,532.02	18,883,800.00	0.00	5,135,267.98	0.46

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/19

PORTEFEUILLE : F5016 EUROSE

Devise de fixing : FXE Dev. Bloomberg 18 h

VALIDATION PARTIELLE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : CLASSEMENT ALPHABETIQUE SUR LIBVAL TTES DEV.CONF., Tris

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
Actions & valeurs ass. nég. sur un marché régl. ou ass.(sauf Warrants et Bons de Sous.)												
CUMUL (EUR)								1,066,265,737.71	1,146,447,440.00	0.00	80,181,702.29	28.20
Bons de souscriptions sur actions négo. sur un marché régl. ou assimilé												
FR0013309614	CGG BSA 1	100,000.	P EUR	0.	M 28/06/19	0.209		0.00	20,900.00	0.00	20,900.00	0.00
Bons de souscriptions sur actions négo. sur un marché régl. ou assimilé												
CUMUL (EUR)								0.00	20,900.00	0.00	20,900.00	
Actions & valeurs assimilées												
CUMUL (EUR)								1,066,265,737.71	1,146,468,340.00	0.00	80,202,602.29	28.20
Obligations & Valeurs assimilées												
Obligations à taux fixe négo. sur un marché régl. ou assimilé												
XS1207309086	ACS 2,875%010420	EXA-01/04/20	119.	P EUR	100.0309	% 28/06/19	102.209	11,903,675.64	12,248,869.63	85,998.63	345,193.99	0.30
FR0011965177	AIR FRA.3,875%0621	EXA-18/06/21	139.	P EUR	103.9531	% 28/06/19	106.057	14,449,483.70	14,762,526.14	20,603.14	313,042.44	0.36
FR0013212958	AIR FRANCE 3,75%22	EXA-12/10/22	14.	P EUR	108.3913	% 28/06/19	106.594	1,517,478.08	1,530,144.77	37,828.77	12,666.69	0.04
XS1892240281	ALD 1,25%111022	EXA-11/10/22	74.	P EUR	99.915	% 28/06/19	102.829	7,393,710.00	7,676,250.10	66,904.10	282,540.10	0.19
XS1084568762	ARCELORMI 2,875%20	EXA-06/07/20	9,000.	P EUR	99.182	% 28/06/19	102.945	8,926,380.00	9,520,964.38	255,914.38	594,584.38	0.23
XS1167308128	ARCELORMI 3,125%22	EXA-14/01/22	2,000.	P EUR	97.9259	% 28/06/19	107.369	1,958,518.43	2,176,318.36	28,938.36	217,799.93	0.05
XS1214673722	ARCELORMI TTAL 3%21	EXA-09/04/21	2,200.	P EUR	110.1308	% 28/06/19	105.262	2,422,878.08	2,330,911.54	15,147.54	-91,966.54	0.06
XS1811053641	BANCO BPM 1,75%23	EXA-24/04/23	11,000.	P EUR	99.64	% 28/06/19	99.135	10,960,400.00	10,941,140.98	36,290.98	-19,259.02	0.27
XS0555834984	BANCO BPM 10/20	EXA-05/11/20	12,849.	P EUR	113.3427	% 28/06/19	105.48	14,563,409.68	14,057,932.48	504,807.28	-505,477.20	0.35
XS1960684063	BANCO BPM 2%080322	EXA-08/03/22	12,800.	P EUR	100.2467	% 28/06/19	100.746	12,831,577.50	12,976,624.60	81,136.60	145,047.10	0.32
XS1266866927	BANCO BPM 2,75%20	EXA-27/07/20	4,800.	P EUR	101.365	% 28/06/19	102.52	4,865,518.43	5,043,918.90	122,958.90	178,400.47	0.12
XS1642700766	BANI JAY 4%010722	DEM-01/07/22	1,900.	P EUR	100.	% 28/06/19	102.53	1,900,000.00	1,948,281.11	211.11	48,281.11	0.05
PTBEQKOM0019	BES 2,625%080517	EXA-31/12/19	90.	P EUR	99.815	% 25/06/19	26.336	8,983,350.00	2,370,240.00	0.00	-6,613,110.00	0.06
PTBENKOM0012	BES 4%0119 EMTN	EXA-31/12/19	72.	P EUR	99.8372	% 28/06/19	29.397	7,188,281.17	2,116,584.00	0.00	-5,071,697.17	0.05
PTBENJOM0015	BES 4,75%150118	EXA-15/01/20	15.	P EUR	99.349	% 25/06/19	28.627	1,490,235.00	429,405.00	0.00	-1,060,830.00	0.01
XS1871106297	BFCM 0,125%300821	EXA-30/08/21	140.	P EUR	99.782	% 28/06/19	100.652	13,969,480.00	14,105,951.23	14,671.23	136,471.23	0.35
XS1884706885	BIL 1,5%280923	EXA-28/09/23	136.	P EUR	99.747	% 28/06/19	102.187	13,565,592.00	14,052,248.43	154,816.43	486,656.43	0.35
FR0013233426	BOLLORE 2%22	EXA-25/01/22	57.	P EUR	103.045	% 28/06/19	102.322	5,873,562.74	5,881,701.94	49,347.94	8,139.20	0.14
FR0012872174	BOLLORE 2,875%0721	EXA-29/07/21	42.	P EUR	106.4503	% 28/06/19	103.658	4,470,911.84	4,465,453.81	111,817.81	-5,458.03	0.11
XS1679158094	CAIXABANK 1,125%23	EXA-12/01/23	113.	P EUR	99.4251	% 28/06/19	102.128	11,235,034.39	11,600,021.18	59,557.18	364,986.79	0.29
FR0013260379	CASINO GU 1,865%22	EXA-13/06/22	132.	P EUR	101.0237	% 28/06/19	84.99	13,335,130.98	11,231,459.83	12,779.83	-2,103,671.15	0.28
FR0011052661	CASINO GU.4,726%21	EXA-26/05/21	277.	P EUR	109.0676	% 28/06/19	93.784	30,211,736.27	26,145,512.31	167,344.31	-4,066,223.96	0.64
XS1713465760	CGG HOLDI 7,875%23	EXA-01/05/23	8,840.	P EUR	106.6961	% 28/06/19	107.31	9,431,937.50	9,604,454.13	118,250.13	172,516.63	0.24
XS1266592457	DUFREY FIN S 4,5%23	EUR-01/08/23	9,370.	P EUR	105.2596	% 28/06/19	103.119	9,862,827.50	9,389,109.05	176,858.75	-23,718.45	0.24
XS0995380580	EDP FINAN 4,125%21	EXA-20/01/21	2,366.	P EUR	99.253	% 28/06/19	106.61	2,348,325.98	2,565,977.23	43,584.63	127,651.25	0.06
FR0013318094	ELIS 1,875%150223	EXA-15/02/23	100.	P EUR	99.6663	% 28/06/19	105.127	9,966,630.05	10,583,076.71	70,376.71	616,446.66	0.26
XS1639097747	FAMAFACTORING 2%22	EXA-29/06/22	10,500.	P EUR	99.9202	% 28/06/19	98.492	10,491,621.40	10,343,381.31	1,721.31	-148,240.09	0.25
XS1785467751	FAURECIA 2,625%25	EUR-15/06/25	16,100.	P EUR	100.2037	% 28/06/19	104.619	16,132,797.93	16,863,616.29	19,957.29	730,818.36	0.41
XS1384278203	FAURECIA 3,625%23	EUR-15/06/23	17,000.	P EUR	104.8509	% 28/06/19	102.226	17,824,653.81	17,407,520.69	29,100.69	-417,133.12	0.43
XS1954697923	FCA BANK 1,25%22	EXA-21/06/22	4,100.	P EUR	99.737	% 28/06/19	102.523	4,089,217.00	4,204,983.30	1,540.30	115,766.30	0.10
XS1111858756	FCA BANK I 2%19	EXA-23/10/19	4,600.	P EUR	101.7355	% 28/06/19	100.661	4,679,832.88	4,693,923.81	63,517.81	14,090.93	0.12
XS1881804006	FCA BANK IE 1%22	EXA-21/02/22	13,000.	P EUR	99.5984	% 28/06/19	101.638	12,947,787.42	13,259,597.53	46,657.53	311,810.11	0.33
XS1720053229	FERRARI 0,25%21	EXA-16/01/21	19,900.	P EUR	99.4858	% 28/06/19	100.314	19,797,678.76	19,985,248.32	22,762.32	187,569.56	0.49
XS1048568452	FIAT CHRYS.4,75%21	EXA-22/03/21	6,100.	P EUR	111.1102	% 28/06/19	107.864	6,777,720.31	6,660,453.99	80,749.99	-117,266.32	0.16
XS0953215349	FIAT CHRYS.6,75%19	EXA-14/10/19	23,120.	P EUR	114.5001	% 28/06/19	101.935	26,472,421.31	24,683,307.88	1,115,935.88	-1,789,113.43	0.61

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/19

PORTEFEUILLE : F5016 EUROSE

Devise de fixing : FXE Dev. Bloomberg 18 h

VALIDATION PARTIELLE Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : CLASSEMENT ALPHABETIQUE SUR LIBVAL TTES DEV.CONF., Tris

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	Devise du portefeuille			PRCT ACT NET		
								<-----> PRIX REVIENT TOTA	VALEUR BOURSIERE	COURON COURU TOTA		-----> PLUS OU MOINS VAL	
XS1088515207	FIAT CHRYSL4, 75%22	EXA-15/07/22	9, 570.	P EUR	114. 5128	% 28/06/19	112. 977		10, 958, 878. 14	11, 250, 283. 56	438, 384. 66	291, 405. 42	0. 28
XS1987729412	FNAC DAR 1, 875%24	EUR-30/05/24	5, 900.	P EUR	100.	% 28/06/19	103. 077		5, 900, 000. 00	6, 096, 293. 00	14, 750. 00	196, 293. 00	0. 15
XS1987729768	FNAC DAR 2, 625%26	EUR-30/05/26	5, 300.	P EUR	100.	% 28/06/19	104. 598		5, 300, 000. 00	5, 562, 244. 00	18, 550. 00	262, 244. 00	0. 14
XS1886399093	GETLINK 3, 625%23	EUR-01/10/23	12, 200.	P EUR	100.	% 28/06/19	105. 029		12, 200, 000. 00	12, 815, 994. 93	2, 456. 93	615, 994. 93	0. 32
XS0478803355	HEIDELBERG. 7, 5%20	EUR-03/04/20	4, 615.	P EUR	122. 3162	% 28/06/19	105. 771		5, 644, 894. 32	4, 966, 901. 44	85, 569. 79	-677, 992. 88	0. 12
FR0013331188	ILIAD 0, 625%251121	EXA-25/11/21	205.	P EUR	98. 4976	% 28/06/19	99. 786		20, 192, 017. 81	20, 533, 005. 00	76, 875. 00	340, 987. 19	0. 50
XS1809245829	INDRA SISTEMA 3%24	EXA-19/04/24	129.	P EUR	98. 657	% 28/06/19	102. 884		12, 726, 753. 00	13, 350, 281. 89	78, 245. 89	623, 528. 89	0. 33
FR0011912872	INGENICO 2, 5%0521	EXA-20/05/21	8.	P EUR	102. 5808	% 28/06/19	104. 096		820, 646. 58	835, 117. 73	2, 349. 73	14, 471. 15	0. 02
FR0013367174	IPSOS 2, 875%210925	EXA-21/09/25	156.	P EUR	99. 184	% 28/06/19	99. 587		15, 472, 704. 00	15, 884, 541. 86	348, 969. 86	411, 837. 86	0. 39
XS0222189564	ITALIE TV20 EMTN	EXA-15/06/20	2, 487.	P EUR	104. 6154	% 28/06/19	101. 8665		26, 017, 841. 62	25, 357, 301. 81	23, 103. 26	-660, 539. 81	0. 62
FR0013153160	LAGARDERE 2, 75%23	EXA-13/04/23	159.	P EUR	103. 0906	% 28/06/19	105. 342		16, 391, 406. 54	16, 844, 951. 77	95, 573. 77	453, 545. 23	0. 41
XS0999654873	LEONARDO 4, 5%21	EXA-19/01/21	1, 800.	P EUR	109. 4135	% 28/06/19	106. 825		1, 969, 442. 62	1, 959, 244. 52	36, 394. 52	-10, 198. 10	0. 05
XS1560991637	LOUIS DR COMP 4%22	EXA-07/02/22	13, 820.	P EUR	106. 562	% 28/06/19	104. 537		14, 726, 863. 46	14, 666, 618. 88	219, 605. 48	-60, 244. 58	0. 36
XS1000918018	LS DR COMPANY 4%20	EXA-04/12/20	22, 550.	P EUR	107. 245	% 28/06/19	104. 04		24, 183, 754. 26	23, 979, 978. 89	518, 958. 89	-203, 775. 37	0. 59
FR0013176294	NEXANS 3, 25%21	EXA-26/05/21	72.	P EUR	100. 4498	% 28/06/19	105. 397		7, 232, 384. 97	7, 612, 239. 74	23, 655. 74	379, 854. 77	0. 19
FR0013354297	NEXANS 3, 75%080823	EXA-08/08/23	155.	P EUR	102. 263	% 28/06/19	109. 292		15, 850, 760. 31	17, 462, 588. 77	522, 328. 77	1, 611, 828. 46	0. 43
XS1043961439	OBRASCON H. 4, 75%22	EXA-15/03/22	11, 400.	P EUR	98. 8861	% 28/06/19	69. 381		11, 273, 018. 00	8, 069, 823. 94	160, 389. 94	-3, 203, 194. 06	0. 20
FR0011791391	ORANO 3, 125%200323	EXA-20/03/23	211.	P EUR	104. 5405	% 28/06/19	105. 661		22, 058, 055. 33	22, 481, 834. 38	187, 363. 38	423, 779. 05	0. 55
FR0011560986	ORANO 3, 25%040920	EXA-04/09/20	333.	P EUR	104. 4661	% 28/06/19	103. 706		34, 787, 200. 34	35, 426, 583. 59	892, 485. 59	639, 383. 25	0. 87
FR0010941690	ORANO 3. 50%21EMTN	EXA-22/03/21	26.	P EUR	106. 2505	% 28/06/19	105. 572		1, 381, 257. 12	1, 385, 116. 33	12, 680. 33	3, 859. 21	0. 03
FR0010817452	ORANO 4, 375%19EMTN	EXA-06/11/19	170.	P EUR	106. 7083	% 28/06/19	101. 57		9, 070, 207. 53	8, 875, 932. 87	242, 482. 87	-194, 274. 66	0. 22
FR0013322187	ORPEA 2, 625%100325	EXA-10/03/25	165.	P EUR	99. 238	% 28/06/19	104. 143		16, 374, 270. 00	17, 318, 502. 78	134, 907. 78	944, 232. 78	0. 43
XS1857022609	OTE 2, 375%180722	EXA-18/07/22	4, 200.	P EUR	99. 718	% 28/06/19	105. 934		4, 188, 156. 00	4, 544, 605. 40	95, 377. 40	356, 449. 40	0. 11
XS1327539976	OTE 4, 375%021219	EXA-02/12/19	13, 711.	P EUR	108. 6987	% 28/06/19	101. 906		14, 903, 680. 46	14, 320, 741. 31	348, 409. 65	-582, 939. 15	0. 35
XS1086785182	OTE PLC 3, 5%090720	EXA-09/07/20	26, 380.	P EUR	107. 0061	% 28/06/19	103. 4		28, 228, 198. 21	28, 182, 512. 87	905, 592. 87	-45, 685. 34	0. 69
FR0013323326	PEUGEOT 2%200325	EXA-20/03/25	165.	P EUR	99. 6198	% 28/06/19	105. 666		16, 437, 259. 68	17, 528, 660. 49	93, 770. 49	1, 091, 400. 81	0. 43
XS1757843146	PIRELLI & 1, 375%23	EXA-25/01/23	28, 768.	P EUR	98. 9687	% 28/06/19	99. 559		28, 471, 311. 96	28, 812, 361. 81	171, 228. 69	341, 049. 85	0. 71
XS1980189028	PSA BQ 0, 5%22 EMTN	EXA-12/04/22	2, 000.	P EUR	99. 938	% 28/06/19	100. 912		1, 998, 760. 00	2, 020, 453. 11	2, 213. 11	21, 693. 11	0. 05
FR0011801596	RALLYE 4%020421	EXA-02/04/21	16.	P EUR	103. 135	% 28/06/19	18. 123	C	1, 650, 159. 54	289, 968. 00	0. 00	-1, 360, 191. 54	0. 01
XS1435297202	SALINI IMP 3, 75%21	EXA-24/06/21	16, 115.	P EUR	102. 0858	% 28/06/19	95. 939		16, 451, 122. 79	15, 473, 778. 86	13, 209. 01	-977, 343. 93	0. 38
DE000A2LQKV2	SIXT LEASIN 1, 5%22	EXA-02/05/22	5, 800.	P EUR	99. 042	% 28/06/19	101. 265		5, 744, 436. 00	5, 887, 870. 00	14, 500. 00	143, 434. 00	0. 14
XS1221105759	SPCM 2, 875%150623	EUR-15/06/23	9, 900.	P EUR	102. 0881	% 28/06/19	101. 254		10, 106, 724. 81	10, 037, 586. 62	13, 440. 62	-69, 138. 19	0. 25
FR0013426376	SPIE 2. 625%180626	EXA-18/06/26	56.	P EUR	100.	% 28/06/19	102. 594		5, 600, 000. 00	5, 750, 886. 95	5, 622. 95	150, 886. 95	0. 14
XS0974375130	TELECOM I 4, 875%20	EXA-25/09/20	10, 500.	P EUR	99. 6119	% 28/06/19	106. 072		10, 459, 252. 39	11, 530, 231. 23	392, 671. 23	1, 070, 978. 84	0. 28
FR0011439900	TEREOS FIN. 4, 25%20	EXA-04/03/20	43.	P EUR	102. 3488	% 28/06/19	100. 235		2, 200, 498. 87	2, 185, 011. 52	29, 959. 02	-15, 487. 35	0. 05
XS1082970853	TESCO COR 1, 375%19	EXA-01/07/19	16, 071.	P EUR	97. 9747	% 28/06/19	100. 028	R	15, 745, 520. 67	16, 075, 499. 88	0. 00	329, 979. 21	0. 40
DE000A1R0410	THYSSENKR 3, 125%19	EXA-25/10/19	3, 700.	P EUR	104. 3426	% 28/06/19	100. 357		3, 860, 675. 68	3, 792, 404. 20	79, 195. 20	-68, 271. 48	0. 09
DE000A14J579	THYSSENKRU 1, 75%20	EXA-25/11/20	16, 500.	P EUR	95. 6576	% 28/06/19	101. 644		15, 783, 503. 73	16, 944, 510. 00	173, 250. 00	1, 161, 006. 27	0. 42
DE000A2AAPF1	THYSSENKRU 2, 75%21	EXA-08/03/21	8, 600.	P EUR	101. 5738	% 28/06/19	103. 231		8, 735, 350. 90	8, 952, 822. 28	74, 956. 28	217, 471. 38	0. 22
XS1807182495	UBI BANCA 1, 75%23	EXA-12/04/23	19, 300.	P EUR	98. 394	% 28/06/19	98. 971		18, 990, 037. 12	19, 176, 150. 94	74, 747. 94	186, 113. 82	0. 47
FR0011302793	VALLLOUREC 3, 25%19	EXA-02/08/19	139.	P EUR	97. 2642	% 28/06/19	100. 296		13, 519, 725. 41	14, 354, 526. 19	413, 382. 19	834, 800. 78	0. 35
XS1700480160	VALLLOUREC 6, 625%17	EUR-15/10/22	10, 500.	P EUR	101. 1471	% 28/06/19	91. 328		10, 620, 448. 88	9, 738, 226. 45	148, 786. 45	-882, 222. 43	0. 24
XS1807435026	VALLLOUREC 6, 375%23	EUR-15/10/23	10, 300.	P EUR	98. 8677	% 28/06/19	88. 952		10, 183, 375. 00	9, 302, 500. 78	140, 444. 78	-880, 874. 22	0. 23
XS1048428012	VW INTL 3, 75%PERP.	EXA-31/12/50	35, 200.	P EUR	107. 6706	% 28/06/19	104. 276		37, 900, 033. 66	37, 065, 807. 72	360, 655. 72	-834, 225. 94	0. 91

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/19

Devise de fixing : FXE Dev. Bloomberg 18 h

PORTEFEUILLE : F5016 EUROSE

VALIDATION PARTIELLE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : CLASSEMENT ALPHABETIQUE SUR LIBVAL TTES DEV.CONF., Tris

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
Obligations à taux fixe négo. sur un marché régl. ou assimilé												
						CUMUL (EUR)		927,150,383.49	913,009,609.25	11,305,583.64	-14,140,774.24	22.45
Obligations à taux variable, révisable négo. sur un marché régl. ou assimilé												
XS1856041287	ALD TV160721	FRN-16/07/21	150.	P EUR	100.	% 28/06/19	100.129	15,000,000.00	15,029,295.83	9,945.83	29,295.83	0.37
XS1782508508	ALD TV260221	FRN-26/02/21	86.	P EUR	99.9819	% 28/06/19	99.926	8,598,444.80	8,593,894.00	258.00	-4,550.80	0.21
XS1723613581	ALD TV271120	FRN-27/11/20	42.	P EUR	100.	% 28/06/19	100.135	4,200,000.00	4,206,174.00	504.00	6,174.00	0.10
XS1878190757	AMADEUS IT TV22	FRN-18/03/22	66.	P EUR	100.	% 28/06/19	100.122	6,600,000.00	6,608,390.80	338.80	8,390.80	0.16
XS1862437909	AT&T TV030820	FRN-03/08/20	30,000.	P EUR	100.2	% 28/06/19	100.225	30,060,000.00	30,072,000.00	4,500.00	12,000.00	0.74
XS1689234570	BANCO SANTAND TV23	FRN-28/03/23	96.	P EUR	99.4386	% 28/06/19	99.985	9,546,104.34	9,598,994.13	434.13	52,889.79	0.24
XS1664643746	BAT CAPIT. TV160821	FRN-16/08/21	12,500.	P EUR	100.	% 28/06/19	100.065	12,500,000.00	12,511,209.38	3,084.38	11,209.38	0.31
XS1840614736	BAYER CAP TV260622	FRN-26/06/22	53.	P EUR	100.	% 28/06/19	99.642	5,300,000.00	5,281,208.85	182.85	-18,791.15	0.13
XS1788584321	BBVA TV090323	FRN-09/03/23	281.	P EUR	100.0218	% 28/06/19	99.217	28,106,136.35	27,884,733.68	4,756.68	-221,402.67	0.69
XS0202290044	BEI TV20 EMTN	EXA-25/01/20	10,000.	P EUR	101.4787	% 28/06/19	100.05	10,147,867.87	10,005,915.21	915.21	-141,952.66	0.25
XS0202784046	BNG TV20	EXA-25/07/20	100.	P EUR	102.9673	% 18/06/19	100.083	10,296,730.43	10,008,300.00	0.00	-288,430.43	0.25
XS1823532996	BNP PARIBAS TV23	FRN-22/05/23	32,000.	P EUR	99.8653	% 28/06/19	100.093	31,956,911.81	32,040,912.00	11,152.00	84,000.19	0.79
FR0013323672	BPCE TV230323	FRN-23/03/23	295.	P EUR	99.8422	% 28/06/19	99.724	29,453,437.76	29,419,642.00	1,062.00	-33,795.76	0.72
FR0010536359	CACIB TV1122 EMTN	EUR-05/11/22	120.	P EUR	101.2	% 28/06/19	100.78	6,072,000.00	6,052,865.46	6,065.46	-19,134.54	0.15
XS0198532334	CACIB_TV04-19	EUR-16/08/19	1,800.	P EUR	100.363	% 28/06/19	99.82	18,065,331.18	17,967,600.00	0.00	-97,731.18	0.44
FR0010120436	CADES TV0720 EMTN	EXA-25/07/20	4,500.	P EUR	100.2119	% 18/04/18	100.215	4,509,534.27	4,509,675.00	0.00	140.73	0.11
XS1768718733	CGGFP Float	EXA-21/02/24	5,836,806.	P EUR	83.7617	% 28/06/19	116.	4,889,008.73	6,804,276.58	33,581.62	1,915,267.85	0.17
XS1787278008	CREDIT AGRICO TV23	FRN-06/03/23	165.	P EUR	100.3773	% 28/06/19	100.073	16,562,252.78	16,515,357.82	3,312.82	-46,894.96	0.41
DE000DL19T02	DEUTSCHE BANK TV22	FRN-16/05/22	141.	P EUR	99.8773	% 28/06/19	96.901	14,082,704.66	13,672,042.67	9,001.67	-410,661.99	0.34
DE000DL19TX8	DEUTSCHE BANK TV20	FRN-07/12/20	102.	P EUR	100.456	% 28/06/19	98.877	10,246,512.00	10,086,729.00	1,275.00	-159,783.00	0.25
XS0318729950	DEUTSCHE BANK TV22	EUR-05/09/22	90.	P EUR	104.3118	% 28/06/19	99.579	4,694,030.35	4,526,384.63	45,329.63	-167,645.72	0.11
XS1828028677	DEUTSCHE TEL TV22	FRN-01/12/22	14,600.	P EUR	100.	% 28/06/19	100.149	14,600,000.00	14,622,106.82	352.82	22,106.82	0.36
XS1731881964	FAMAFACORING TV20	FRN-05/06/20	6,975.	P EUR	100.03	% 28/06/19	99.838	6,977,093.03	6,969,596.12	5,895.62	-7,496.91	0.17
XS1753030490	FCA BANK IE TV21	FRN-17/06/21	7,500.	P EUR	99.8717	% 28/06/19	99.488	7,490,380.13	7,461,637.50	37.50	-28,742.63	0.18
XS1917614569	HSBC HLDGS TV21	FRN-04/12/21	11,500.	P EUR	100.	% 28/06/19	100.821	11,500,000.00	11,599,584.88	5,169.88	99,584.88	0.29
XS1882544205	ING GROUP TV200923	FRN-20/09/23	182.	P EUR	100.0513	% 28/06/19	101.185	18,209,330.25	18,418,873.20	3,203.20	209,542.95	0.45
XS0303553779	INTESA TV0622	EUR-15/06/22	160.	P EUR	91.6751	% 28/06/19	98.388	7,334,007.60	7,872,014.66	974.66	538,007.06	0.19
XS0202421672	KREDITANS. TV20	EXA-25/07/20	10,000.	P EUR	100.1847	% 28/06/19	99.953	10,018,471.74	9,995,300.00	0.00	-23,171.74	0.25
XS1884702207	NATWEST MKTS TV21	FRN-27/09/21	7,000.	P EUR	99.849	% 28/06/19	100.544	6,989,430.00	7,038,619.58	539.58	49,189.58	0.17
XS0690213870	ORANGE TV11-131021	EUR-13/10/21	171.	P EUR	106.7452	% 28/06/19	102.191	18,253,430.02	17,687,494.23	212,833.23	-565,935.79	0.44
XS1794213055	PAPREC HOLDIN TV25	EUR-31/03/25	9,800.	P EUR	99.5423	% 28/06/19	95.141	9,755,145.83	9,353,354.10	29,536.10	-401,791.73	0.23
FR0013260486	RCI BANQUE TV22	FRN-14/03/22	11,400.	P EUR	100.	% 28/06/19	100.017	11,400,000.00	11,403,944.40	2,006.40	3,944.40	0.28
FR0013309606	RE.CR. I.N. TV23 EMTN	FRN-12/01/23	13,200.	P EUR	98.9364	% 28/06/19	98.407	13,059,600.00	12,993,288.00	3,564.00	-66,312.00	0.32
FR0013264884	SAFRAN TV280621	FRN-28/06/21	86.	P EUR	100.	% 28/06/19	100.06	8,600,000.00	8,605,376.91	216.91	5,376.91	0.21
FR0013321791	SOCIETE GENER TV23	FRN-06/03/23	280.	P EUR	99.6718	% 28/06/19	99.153	27,908,112.72	27,765,428.43	2,588.43	-142,684.29	0.68
FR0013237484	SOLOCAL TV22	EUR-15/03/22	12,327,471.	P EUR	118.0844	% 28/06/19	94.418	14,556,815.62	11,685,922.01	46,570.44	-2,870,893.61	0.29
XS1734547919	VOLKSWAGEN BA TV21	FRN-15/06/21	57.	P EUR	100.	% 28/06/19	99.896	5,700,000.00	5,694,314.25	242.25	-5,685.75	0.14
XS1830992563	VOLKSWAGEN BA TV21	FRN-08/12/21	70.	P EUR	100.	% 28/06/19	100.362	7,000,000.00	7,026,952.72	1,612.72	26,952.72	0.17
XS1794195724	WPP FINANCE TV22	EXA-20/03/22	5,900.	P EUR	99.8732	% 28/06/19	99.464	5,892,520.00	5,868,624.28	248.28	-23,895.72	0.14

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/19

PORTEFEUILLE : F5016 EUROSE

Devise de fixing : FXE Dev. Bloomberg 18 h

VALIDATION PARTIELLE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : CLASSEMENT ALPHABETIQUE SUR LIBVAL TTES DEV.CONF., Tris

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
Obligations à taux variable, révisable négo. sur un marché régl. ou assimilé												
CUMUL (EUR)								486,131,344.27	483,458,033.13	451,292.10	-2,673,311.14	11.89
Obligations convertibles négo. sur un marché régl. ou assimilé												
XS1238034695	AMER. MOV. 0%280520	EXA-28/05/20	550.	P EUR	98.4494	% 28/06/19	99.617	54,147,190.00	54,789,350.00	0.00	642,160.00	1.35
BE6302890247	ECONOCOM 0,5%23 CV	EXA-06/03/23	180,000.	P EUR	7.038	M 28/06/19	7.213	1,266,844.65	1,298,340.00	2,315.51	31,495.35	0.03
DE000A161GV3	HANIEL 0%120520 CV	EXA-12/05/20	90.	P EUR	99.1131	% 28/06/19	99.697	8,920,175.00	8,972,730.00	0.00	52,555.00	0.22
XS1500463358	INDRA 1,25%1023 CV	EXA-07/10/23	89.	P EUR	101.1059	% 28/06/19	100.387	8,998,423.17	8,960,583.71	26,140.71	-37,839.46	0.22
DE000A185XT1	KLOCKNER 2%0923CV	EXA-08/09/23	41.	P EUR	100.645	% 28/06/19	96.475	4,126,443.32	3,981,322.82	25,847.82	-145,120.50	0.10
XS1551933010	PRYSMIAN 17/22 ZO	EXA-17/01/22	108.	P EUR	93.7227	% 28/06/19	96.91	10,122,052.10	10,466,280.00	0.00	344,227.90	0.26
FR0013237070	SOLOCAL 0%17-22MCB	EXA-14/03/22	114,796.	P EUR	2.113	M 03/05/19	0.47	242,568.14	53,954.12	0.00	-188,614.02	0.00
XS1209185161	TELECOM 1,125%22CV	EXA-26/03/22	370.	P EUR	98.4697	% 28/06/19	98.731	36,433,773.30	36,641,319.15	110,849.15	207,545.85	0.90
FR0013285046	VALLOUREC 4,125%22	EXA-04/10/22	783,744.	P EUR	6.89	M 28/06/19	5.544	5,399,996.16	4,345,076.74	51,873.25	-1,054,919.42	0.11
FR0013134681	VEOLIA 0%21 OCEANE	EXA-15/03/21	1,191,227.	P EUR	29.6304	M 28/06/19	29.999	35,296,559.99	35,735,618.77	0.00	439,058.78	0.88
FR0013169810	WENDEL 0%19 OCEANE	EXA-31/07/19	45,000.	P EUR	51.96	M 28/06/19	51.957	2,338,200.00	2,338,065.00	0.00	-135.00	0.06
Obligations convertibles négo. sur un marché régl. ou assimilé												
CUMUL (EUR)								167,292,225.83	167,582,640.31	217,026.44	290,414.48	4.12
Obligations indexées négo. sur un marché régl. ou assimilé												
FR0011301480	CASINO 3,157%0819	EXA-06/08/19	100.	P EUR	101.9362	% 28/06/19	99.553	10,193,616.59	10,353,741.09	398,441.09	160,124.50	0.25
FR0011765825	CASINO TV14-0324	EXA-07/03/24	124.	P EUR	89.8854	% 28/06/19	86.57	11,145,784.07	10,912,977.76	178,297.76	-232,806.31	0.27
Obligations indexées négo. sur un marché régl. ou assimilé												
CUMUL (EUR)								21,339,400.66	21,266,718.85	576,738.85	-72,681.81	0.52
Obligations hypothécaires et foncières négo. sur un marché régl. ou assimilé												
FR0010120501	FINA. FONC. TV250720	EXA-25/07/20	19,750.	P EUR	98.4878	% 28/06/19	100.031	C 19,451,331.62	19,756,122.50	0.00	304,790.88	0.49
Obligations hypothécaires et foncières négo. sur un marché régl. ou assimilé												
CUMUL (EUR)								19,451,331.62	19,756,122.50	0.00	304,790.88	0.49
Titres participatifs												
FR0000140014	RENAULT TPA 83-84	EXA-31/12/50	44,387.	P EUR	317.6563	M 28/06/19	552.	14,099,812.22	24,501,624.00	0.00	10,401,811.78	0.60
Titres participatifs												
CUMUL (EUR)								14,099,812.22	24,501,624.00	0.00	10,401,811.78	0.60
Titres subordonnés (TSR - TSDI)												
FR0012005924	ACCOR TV14-PERP	EXA-31/12/50	202.	P EUR	107.9433	% 28/06/19	103.732	21,804,547.61	20,958,417.26	4,553.26	-846,130.35	0.52
FR0012650281	AIR FR. KLM TV%PERP	EXA-31/12/50	86.	P EUR	111.342	% 28/06/19	106.259	9,575,412.54	9,541,767.15	403,493.15	-33,645.39	0.23
FR0012278539	ARKEMA TV-PERP	EXA-31/12/50	2.	P EUR	110.7048	% 28/06/19	105.975	221,409.67	218,352.74	6,402.74	-3,056.93	0.01
FR0010154385	CASINO 7,5% PERP.	FRN-31/12/50	30,683.	P EUR	66.4646	% 28/06/19	30.871	20,393,326.94	9,570,640.50	98,491.57	-10,822,686.44	0.24
DE000DB5DCW6	DBK 5%240620 SUB	EXA-24/06/20	488.	P EUR	113.5295	% 28/06/19	103.476	27,701,203.70	25,274,810.66	26,666.66	-2,426,393.04	0.62
FR0011697010	EDF 4,125% 14-PERP	EXA-31/12/50	61.	P EUR	110.0226	% 28/06/19	107.307	6,711,379.81	6,656,717.75	110,990.75	-54,662.06	0.16
FR0011401736	EDF TV PERP EMTN	EXA-31/12/50	180.	P EUR	107.7389	% 28/06/19	102.524	19,393,009.70	18,777,087.11	322,767.11	-615,922.59	0.46
XS1014997073	ENEL TV150175	EXA-15/01/75	4,050.	P EUR	109.6565	% 28/06/19	102.713	4,441,086.93	4,253,081.98	93,205.48	-188,004.95	0.10
XS0971213201	INTESA SA. 6,625%23	EXA-13/09/23	5,200.	P EUR	118.2956	% 28/06/19	119.082	6,151,371.90	6,467,864.00	275,600.00	316,492.10	0.16
XS0452166324	INTESA SAN 5%0919	EXA-23/09/19	680.	P EUR	109.7697	% 28/06/19	101.108	37,321,683.35	35,690,144.66	1,313,424.66	-1,631,538.69	0.88
BE0002479542	KBC GP 2,375%1124	EXA-25/11/24	38.	P EUR	106.6014	% 28/06/19	100.839	4,050,852.06	3,886,032.00	54,150.00	-164,820.06	0.10
XS0972588643	TELEFONICA TVPERP.	EXA-31/12/50	39.	P EUR	122.3188	% 28/06/19	115.356	4,770,432.56	4,732,710.37	233,826.37	-37,722.19	0.12
XS1050460739	TELEFONICA TVPERP	EXA-31/12/50	156.	P EUR	109.5362	% 28/06/19	103.675	17,087,644.63	16,371,496.72	198,196.72	-716,147.91	0.40

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/19

PORTEFEUILLE : F5016 EUROSE

Devise de fixing : FXE Dev. Bloomberg 18 h

VALIDATION PARTIELLE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : CLASSEMENT ALPHABETIQUE SUR LIBVAL TTES DEV.CONF., Tris

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	COURON COURU TOTA	>-----> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET	
XS0618847775	UNICRED. 6, 125%0421	EXA-19/04/21	1,800.	P EUR	117.4647	% 28/06/19	109.658	2,114,364.63	1,996,134.98	22,290.98	-118,229.65	0.05	
XS0849517650	UNICREDIT 6, 95%22	EXA-31/10/22	18,600.	P EUR	124.0827	% 28/06/19	117.155	23,079,386.58	22,654,991.10	864,161.10	-424,395.48	0.56	
XS0986063864	UNICREDIT TV13-25	EXA-28/10/25	900.	P EUR	113.1836	% 28/06/19	105.326	1,018,652.05	982,953.86	35,019.86	-35,698.19	0.02	
Titres subordonnés (TSR - TSDI)													
								CUMUL (EUR)	205,835,764.66	188,033,202.84	4,063,240.41	-17,802,561.82	4.62
Obligations & Valeurs assimilées													
								CUMUL (EUR)	1,841,300,262.75	1,817,607,950.88	16,613,881.44	-23,692,311.87	44.70
Titres de créances													
Bons du Trésor													
ES00000126W8	ESPANA 0,55%30119	EXA-30/11/19	56,500.	P EUR	101.442	% 28/06/19	100.546	57,314,711.91	59,722,246.56	190,925.64	2,407,534.65	1.47	
ES00000126A4	ESPANA 1,8%301124	EXA-30/11/24	79,800.	P EUR	107.3229	% 28/06/19	115.229	85,643,709.45	97,242,565.04	882,528.12	11,598,855.59	2.39	
IT0005090318	ITALIE 1,5%25 BTP	EXA-01/06/25	8,600.	P EUR	100.0622	% 28/06/19	100.08	8,605,347.87	8,617,806.30	10,926.30	12,458.43	0.21	
IT0004380546	ITALIE 2,35%150919	EXA-15/09/19	33,600.	P EUR	120.5439	% 28/06/19	100.559	40,502,733.92	39,413,799.42	270,943.19	-1,088,934.50	0.97	
IT0004243512	ITALIE TV0923 INDX	EXA-15/09/23	57,000.	P EUR	119.8715	% 28/06/19	108.403	68,326,745.57	74,350,818.14	524,472.63	6,024,072.57	1.83	
IT0005012783	ITALIE TV230420	EXA-23/04/20	83,800.	P EUR	105.8749	% 28/06/19	101.248	88,723,202.79	85,385,177.84	265,301.83	-3,338,024.95	2.10	
IT0004735152	ITALY 3,1%150926	EXA-15/09/26	43,000.	P EUR	131.8417	% 28/06/19	114.098	56,691,912.94	54,889,323.92	438,198.46	-1,802,589.02	1.35	
IT0005004426	ITALY TV0924 INDX	EXA-15/09/24	107,000.	P EUR	116.7787	% 28/06/19	107.73	124,953,201.66	122,015,065.57	783,296.99	-2,938,136.09	3.00	
IT0005312142	ITALY TV201123 IDX	EXA-20/11/23	12,650.	P EUR	100.0933	% 28/06/19	96.982	12,661,798.93	12,293,516.64	3,701.57	-368,282.29	0.30	
Bons du Trésor													
								CUMUL (EUR)	543,423,365.04	553,930,319.43	3,370,294.73	10,506,954.39	13.62
Titres négociables à court terme (NEU CP) émis par des émetteurs bancaires													
FR0125535437	RECTIC NCP08072019	NOL 999-08/07/19	9,000,000.	EUR	0.9994	28/06/19	0.	8,994,316.05	8,999,437.85	0.00	5,121.80	0.22	
FR0125536211	NEXANS NCP18072019	NOL 999-18/07/19	9,000,000.	EUR	0.9994	28/06/19	0.	8,994,784.08	8,998,863.28	0.00	4,079.20	0.22	
FR0125600900	CGP NCP10072019	NOL 999-10/07/19	22,000,000.	EUR	0.9991	28/06/19	0.	21,980,553.32	21,997,649.30	0.00	17,095.98	0.54	
FR0125615221	EUROPC NCP14082019	NOL 999-14/08/19	12,000,000.	EUR	0.999	28/06/19	0.	11,988,181.56	11,994,025.84	0.00	5,844.28	0.29	
FR0125616286	VALLOU NCP23072019	NOL 999-23/07/19	9,000,000.	EUR	0.999	28/06/19	0.	8,990,909.19	8,997,602.42	0.00	6,693.23	0.22	
FR0125643397	ALTRAN NCP02082019	NOL 999-02/08/19	5,200,000.	EUR	0.9996	28/06/19	0.	5,198,073.82	5,199,288.15	0.00	1,214.33	0.13	
FR0125663924	ECONOC NCP28082019	NOL 999-28/08/19	10,000,000.	EUR	0.9995	28/06/19	0.	9,994,891.50	9,996,668.37	0.00	1,776.87	0.25	
FR0125663965	ALTICE NCP28082019	NOL 999-28/08/19	12,000,000.	EUR	0.999	28/06/19	0.	11,987,745.84	11,992,008.16	0.00	4,262.32	0.29	
FR0125664914	ECONOC NCP19092019	NOL 999-19/09/19	8,000,000.	EUR	0.9994	28/06/19	0.	7,995,300.48	7,995,811.30	0.00	510.82	0.20	
FR0125717324	VALLOU NCP27092019	NOL 999-27/09/19	16,000,000.	EUR	0.999	28/06/19	0.	15,983,661.12	15,984,016.31	0.00	355.19	0.39	
Titres négociables à court terme (NEU CP) émis par des émetteurs bancaires													
								CUMUL (EUR)	112,108,416.96	112,155,370.98	0.00	46,954.02	2.76
Euro Commercial Paper													
DE000A2X1GS2	ECP THYSSEN. 100719	NOL 999-10/07/19	22,000,000.	EUR	99.9469	28/06/19	0.	21,988,327.86	21,998,589.08	0.00	10,261.22	0.54	
XS2003417834	ECP SYNGENTA 0% 19	NOL 999-23/07/19	26,000,000.	EUR	99.9813	28/06/19	0.	25,995,147.57	25,997,920.39	0.00	2,772.82	0.64	
XS2017308052	ECP K+S AG 0% 2019	NOL 999-20/09/19	14,000,000.	EUR	99.9438	28/06/19	0.	13,992,173.31	13,992,938.96	0.00	765.65	0.34	
Euro Commercial Paper													
								CUMUL (EUR)	61,975,648.74	61,989,448.43	0.00	13,799.69	1.52

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/19

PORTEFEUILLE : F5016 EUROSE

Devise de fixing : FXE Dev. Bloomberg 18 h

VALIDATION PARTIELLE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : CLASSEMENT ALPHABETIQUE SUR LIBVAL TTES DEV.CONF., Tris

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
Titres de créances												
CUMUL (EUR)								717,507,430.74	728,075,138.84	3,370,294.73	10,567,708.10	17.91
Titres d'OPC												
OPCVM Français à vocation générale/formule/indiciel/allégé/alternatif/ETF(trackers)												
FR0013248424	DNCA BE. E. LEA. I 4D	55,000.	P EUR	99.3682	M 27/06/19	101.28		5,465,250.00	5,570,400.00	0.00	105,150.00	0.14
FR0013270345	DNCA OPP. ZON. EUR. F	145,000.	P EUR	101.9338	M 27/06/19	85.18		14,780,400.00	12,351,100.00	0.00	-2,429,300.00	0.30
FR0011637065	DNCA PME I FCP 4D	21,000.	P EUR	173.2	M 27/06/19	127.47		3,637,200.00	2,676,870.00	0.00	-960,330.00	0.07
FR0010885236	OST. TRES. PL. IC 4D	1,850.	P EUR	103512.0656	M 27/06/19	103448.81		191,497,321.36	191,380,298.50	0.00	-117,022.86	4.71
OPCVM Français à vocation générale/formule/indiciel/allégé/alternatif/ETF(trackers)												
CUMUL (EUR)								215,380,171.36	211,978,668.50	0.00	-3,401,502.86	5.21
OPCVM européens coordonnés et assimilables (non français)												
LU1366712351	DI ARC. M. -C. E. E 4D	35,000.	P EUR	138.7811	M 27/06/19	132.75		4,857,340.00	4,646,250.00	0.00	-211,090.00	0.11
LU1907594664	DNCA BEY. ALT. I 4D	105,000.	P EUR	102.8895	M 27/06/19	106.53		10,803,400.00	11,185,650.00	0.00	382,250.00	0.28
LU1907595125	DNCA BEY. SEMP. I 4D	25,000.	P EUR	106.09	M 27/06/19	116.97		2,652,250.00	2,924,250.00	0.00	272,000.00	0.07
LU0284395984	DNCA CENT. EUR. IC4D	100,000.	P EUR	140.8309	M 27/06/19	171.97		14,083,093.59	17,197,000.00	0.00	3,113,906.41	0.42
LU1694789964	DNCA IN. F. INF. I 4D	200,000.	P EUR	100.0596	M 27/06/19	100.66		20,011,916.67	20,132,000.00	0.00	120,083.33	0.50
LU0462973008	DNCA IN. MIURA IC4D	190,000.	P EUR	117.1766	M 27/06/19	108.92		22,263,549.18	20,694,800.00	0.00	-1,568,749.18	0.51
LU0309082104	DNCA INF. LIF. IC. 4D	30,000.	P EUR	165.82	M 27/06/19	161.95		4,974,600.00	4,858,500.00	0.00	-116,100.00	0.12
LU1694789378	DNCA INV. AL. B. I 4D	240,000.	P EUR	100.3048	M 27/06/19	102.34		24,073,161.82	24,561,600.00	0.00	488,438.18	0.60
LU0641746143	DNCA MIURI IEC 4D.	85,000.	P EUR	115.9276	M 27/06/19	113.36		9,853,850.00	9,635,600.00	0.00	-218,250.00	0.24
LU0284395125	DNCA S. EUR. OP. IC4D	80,000.	P EUR	74.3257	M 27/06/19	105.92		5,946,054.34	8,473,600.00	0.00	2,527,545.66	0.21
LU0388707183	FONDIT. EQ. ITALY T	1,499,999.957	P EUR	15.5232	M 28/06/19	19.203		23,284,740.04	28,804,499.17	0.00	5,519,759.13	0.71
OPCVM européens coordonnés et assimilables (non français)												
CUMUL (EUR)								142,803,955.64	153,113,749.17	0.00	10,309,793.53	3.77
Titres d'OPC												
CUMUL (EUR)								358,184,127.00	365,092,417.67	0.00	6,908,290.67	8.98
PORTEFEUILLE TITRES												
CUMUL (EUR)								3,983,257,558.20	4,057,243,847.39	19,984,176.17	73,986,289.19	99.78
TRESORERIE												
Dettes et créances												
SRD et règlements différés												
AT01. EUR	Ach. titr rgt. différé	-14,132,739.02	EUR	1.		1.		-14,132,739.02	-14,132,739.02	0.00	0.00	-0.35
VT01. EUR	Vt titr. req. différé	34,524,677.79	EUR	1.		1.		34,524,677.79	34,524,677.79	0.00	0.00	0.85
SRD et règlements différés												
CUMUL (EUR)								20,391,938.77	20,391,938.77	0.00	0.00	0.50

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/19

PORTEFEUILLE : F5016 EUROSE

Devise de fixing : FXE Dev. Bloomberg 18 h

VALIDATION PARTIELLE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : CLASSEMENT ALPHABETIQUE SUR LIBVAL TTES DEV.CONF., Tris

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													
FR0000034639	ALTRAN TECHN.	457,600.	P EUR	0.24	28/06/19	0.		109,824.00	109,824.00	0.00		0.00 0.00	
FR0000120172	CARREFOUR	1,300,000.	P EUR	0.46	28/06/19	0.		598,000.00	598,000.00	0.00		0.00 0.01	
FR0000130577	PUBLICIS GROUPE	540,000.	P EUR	2.12	28/06/19	0.		1,144,800.00	1,144,800.00	0.00		0.00 0.03	
FR0012005924	ACCOR TV14-PERP	202.	P EUR	4125.	28/06/19	0.		833,250.00	833,250.00	0.00		0.00 0.02	
XS1639097747	FAMAFAC. 2% 0622	10,500.	P EUR	20.	28/06/19	0.		210,000.00	210,000.00	0.00		0.00 0.01	
XS1642700766	BANIJAY 010722	1,900.	P EUR	20.	28/06/19	0.		38,000.00	38,000.00	0.00		0.00 0.00	
XS1886399093	GETLINK 3,625% 23	12,200.	P EUR	18.125	28/06/19	0.		221,125.00	221,125.00	0.00		0.00 0.01	
XS1082970853	TESCO COR 1,375%19	16,071.	P EUR	13.75	28/06/19	0.		220,976.25	220,976.25	0.00		0.00 0.01	
Coupons et dividendes													
								CUMUL (EUR)	3,375,975.25	3,375,975.25	0.00	0.00 0.08	
Frais de gestion													
FGES.EUR	Prov frais gestion	-4,300,630.94	EUR	1.		1.		-4,300,630.94	-4,300,630.94	0.00		0.00 -0.11	
Frais de gestion													
								CUMUL (EUR)	-4,300,630.94	-4,300,630.94	0.00	0.00 -0.11	
Dettes et créances													
								CUMUL (EUR)	19,467,283.08	19,467,283.08	0.00	0.00 0.48	
Disponibilités													
Comptes à vue													
BQ01.EUR	Banque	-10,639,986.37	EUR	1.		1.		-10,639,986.37	-10,639,986.37	0.00		0.00 -0.26	
Comptes à vue													
								CUMUL (EUR)	-10,639,986.37	-10,639,986.37	0.00	0.00 -0.26	
Disponibilités													
								CUMUL (EUR)	-10,639,986.37	-10,639,986.37	0.00	0.00 -0.26	
TRESORERIE													
								CUMUL (EUR)	8,827,296.71	8,827,296.71	0.00	0.00 0.22	
PORTEFEUILLE : EUROSE (F5016)													
								(EUR)	3,992,084,854.91	4,066,071,144.10	19,984,176.17	73,986,289.19	100.00

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 28/06/19

PORTEFEUILLE : F5016 EUROSE

Devise de fixing : FXE Dev. Bloomberg 18 h

VALIDATION PARTIELLE

Devise du portefeuille : EUR

(Etat simplifie, trame : CLASSEMENT ALPHABETIQUE SUR LIBVAL TTES DEV.CONF., Tris

Portefeuille titres : 4,057,243,847.39 Coupons et dividendes a recevoir : 3,375,975.25

Frais de gestion du jour

C1 Prov frais gestion : 151,797.52 EUR
 C2 Prov frais gestion : 21.21 EUR
 L1 Prov frais gestion : 2,223.94 EUR

Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
C1 FRO007051040 PART CAPI C	EUR	3,971,756,369.62	10,614,250.1569	374.19	97.680477216709			374.19	374.19
C2 FRO013311537 PART CAPI S	EUR	3,882,920.53	38,965.4217	99.65	0.095492540615			99.65	99.65
L1 FRO013294311 PART CAPI N	EUR	90,431,853.95	239,811.76	377.09	2.224030242676			377.09	377.09

Actif net total en EUR : 4,066,071,144.10

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

Type reporting : TISF TIS France

Poids officiels et statuts en date du 31/12/18 :

Poids DD : 62.21 Statut DD : I
 Poids DI : 71.22 Statut DI : M

Mixed fund - Poids calcule de 30.05 % (pour un seuil de 25. %)