

CAPITAL PRUDENCE

Fonds Commun de Placement

Société de Gestion :
Roche-Brune Asset Management

19 rue Vivienne
75002 Paris

Attestation du Commissaire aux Comptes relative à la composition de l'actif

Exercice clos le 29 mars 2019

CAPITAL PRUDENCE

Fonds Commun de Placement

Société de Gestion :
Roche-Brune Asset Management

19 rue Vivienne
75002 Paris

Attestation du Commissaire aux Comptes relative à la composition de l'actif

Exercice clos le 29 mars 2019

En notre qualité de commissaire aux comptes du Fonds Commun de Placement CAPITAL PRUDENCE et en application des dispositions prévues par l'article L 214-17 du Code monétaire et financier 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 mars 2019 ci-jointe.

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

A Paris La Défense, le 23 mai 2019

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés



Olivier GALIENNE

**BNP PARIBAS****Inventaires par produit et devise de cotation à la dernière date de VL****Fonds: CAPITAL PRUDENCE (PRB003) EUR****Dernière date de VL: 29/03/2019**

Classe (VL)		Code ISIN Part	Actif Net Part en Dev. de Réf.	Nb. Parts	Disponibilités	VL (dev part) 3/29/19	VL préc. (dev part) 3/28/19	Var. VL (%)	Statut	Dev. Part
C cap		FR0010356717	3,347,192.800000	3,004.7500000000	565,504.94	1,113.960000	1,113.530000	0.04	VAL	EUR
P cap		FR0010823666	3,492,026.720000	3,475.5860000000	565,504.94	1,004.730000	1,004.310000	0.04	VAL	EUR
U cap		FR0013310844	4,367,355.360000	4,515.0000000000	565,504.94	967.290000	966.880000	0.04	VAL	EUR

Code valeur	Lib. court valeur	Libellé type instrument	VBT (dev cot)	Dev cot	S/C	PRU (dev cot)	Cours	Dt cours Orig	PRT (dev réf)	VBT (dev réf)	CCT (dev réf)	PMVT (dev réf)	% AN
3510000	Appels de marge	Disponibilités	-5,520,000,000,000,000	EUR						-5,520.00			-0.0500%
4161000	Cite cash donné en garantie	Disponibilités	36,850,700,000,000,000	EUR						36,850.70			0.3300%
4680100	Prov frais gestion glob 1C	Disponibilités	-1,595,280,000,000,000	EUR						-1,595.28			-0.0100%
4680200	Prov frais gestion glob 24C	Disponibilités	-2,802,100,000,000,000	EUR						-2,802.10			-0.0300%
4680360	Prov frais gestion glob 45C	Disponibilités	-1,737,000,000,000,000	EUR						-1,737.00			-0.0200%
4697100	Prov FDG variables 1C	Disponibilités	-2,278,310,000,000,000	EUR						-2,278.31			-0.0200%
4698100	Prov FDG variables acquis 1C	Disponibilités	-199,640,000,000,000	EUR						-199.64			0.0000%
4698200	Prov FDG variables acquis 24C	Disponibilités	-0,620,000,000,000	EUR						-0.62			0.0000%
5110300	Cash BP2S BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES	Disponibilités	542,787,190,000,000,000	EUR						542,787.19			4.8400%
Total devise :			565,504,940,000,000,000	EUR						565,504.94			5.0400%
Total instrument: Disponibilités										565,504.94			5.0400%

Code valeur	Lib. court valeur	Libellé type instrument	Quantité	Dev cot	S/C	PRU (dev cot)	Cours	Dt cours Orig	PRT (dev réf)	VBT (dev réf)	CCT (dev réf)	PMVT (dev réf)	% AN
OATM9 - 13	EURO OAT FUTURE FRENCH GOVT B 06/06/2019	Futures	3,000,000,000,000	EUR	A	158.310000	162.67	29/03/2019 Con	474,930.00	13,080.00	0.00	13,080.00	0.1200%
SXOM9 - 14	STOXX 600(SXXF) 21/06/2019	Futures	-27,000,000,000,000	EUR	V	366.700000	372.30	29/03/2019 Con	-495,045.00	-7,560.00	0.00	-7,560.00	-0.0700%
Total devise :				EUR						5,520.00			0.0500%
Total instrument: Futures				EUR						5,520.00			0.0500%
CS1PRB003	Cite cash donné en garantie	Garanties	36,850,700,000,000,000	EUR		1.000000	1.00	29/03/2019	36,850.70	0.00		0.00	0.0000%
Total devise :				EUR						36,850.70			0.0000%
Total instrument: Garanties				EUR						36,850.70			0.0000%
FR0000985658	AVIVA INVESTORS MONETAIRE-C	OPCVM	960,580,000,000,000	EUR		2,247.325418	2,242.57	28/03/2019 Con	2,158,735.65	2,154,167.89	0.00	-4,567.96	19.2200%
FR0010389254	UNION MONIEPLUS	OPCVM	2,620,000,000,000	EUR		594,062.049618	593,688.71	29/03/2019 Con	1,556,442.57	1,555,464.42	0.00	-978.15	13.8800%



BNP PARIBAS

Inventaires par produit et devise de cotation à la dernière date de VL

Fonds: CAPITAL PRUDENCE (PRB003) EUR

Dernière date de VL: 29/03/2019

Code valeur	Lib. court valeur	Libellé type instrument	Quantité	Dev cot	S/C	PRU (dev cot)	Cours	Dt cours Orig	PRT (dev réf)	VBT (dev réf)	CCT (dev réf)	PMVT (dev réf)	% AN
FR0010609115	LA FRANCAISE TRESORERIE-I	OPCVM	19,810000000000	EUR		108,184,887,431	108,007,33	28/03/2019 Con	2,143,142,62	2,139,625,21	0,00	-3,517,41	19,0900%
FR0010814806	TIKEHAU TAUX VARIABLE-A ACC	OPCVM	6,690,833000000000	EUR		126,162,460	126,22	28/03/2019 Jus	844,131,95	844,516,94	0,00	384,99	7,5400%
FR0011686930	ROCHE-BRUNE EUROPE ACTIONS-I	OPCVM	635,060000000000	EUR		1,377,123,768	1,287,46	29/03/2019 Jus	874,556,22	817,614,35	0,00	-66,941,87	7,3000%
IE00BYMFFS46	LYXOR / CHEN CREDIT FD-SIP	OPCVM	2,920,000000000000	EUR		106,051,199	102,66	28/03/2019 Jus	309,669,50	299,772,16	0,00	-9,897,34	2,6700%
LU0151325312	CANDR BONDS-HIGH SPREAD-I-C	OPCVM	2,447,000000000000	EUR		225,710,000	225,96	28/03/2019 Con	552,312,37	552,924,12	0,00	611,75	4,9300%
LU0490769915	JANUS HENDERSON UK ABSOLUTE RETURN FUND	OPCVM	69,845,000000000000	EUR		7,086,600	7,09	29/03/2019 Con	494,963,58	494,991,52	0,00	27,94	4,4200%
LU0549545142	BLUEBAY INV GR EUR AGG BDI	OPCVM	3,350,000000000000	EUR		167,570,000	170,16	29/03/2019 Con	561,359,50	570,036,00	0,00	8,676,50	5,0900%
LU1011993711	ABERBEEN GL-FMB-XACCHEUR	OPCVM	39,256,270000000000	EUR		12,285,148	12,87	29/03/2019 Con	482,269,07	505,055,47	0,00	22,786,40	4,5100%
LU1280365633	DYNASTY SICAV GLOBAL CONVERTIBLES B	OPCVM	2,572,000000000000	EUR		114,561,026	109,92	29/03/2019 Jus	294,650,96	282,714,24	0,00	-11,936,72	2,5200%
LU1402171661	AS SICAV I-DIVERS GRW - IAEUR	OPCVM	37,272,880000000000	EUR		11,431,196	11,23	29/03/2019 Jus	425,073,60	418,667,62	0,00	-7,405,98	3,7400%
Total devise : EUR													
									10,698,307,79	10,695,549,94	0,00	-62,757,85	94,9100%
									10,698,307,79	10,695,549,94	0,00	-62,757,85	94,9100%
									10,715,043,49	11,206,574,88	0,00	-57,237,85	100,0000%
FONDS:	CAPITAL PRUDENCE (PRB003) EUR												