

# **ROCHE BRUNE ZONE EURO ACTIONS**

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**

au 30 septembre 2019

## ROCHE BRUNE ZONE EURO ACTIONS

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

au 30 septembre 2019

---

En notre qualité de commissaire aux comptes du Fonds Commun de Placement ROCHE BRUNE ZONE EURO ACTIONS 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 30 septembre 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 22 novembre 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: ROCHE-BRUNE ZONE EURO ACTIONS (PRB002) EUR

Dernière date de VL: 30/09/2019

Classe (VL)	Code ISIN Part	Actif Net Part en Dev. de Réf.	Nb. Parts	Disponibilités	VL (dev part) 9/30/19	VL préc. (dev part) 9/27/19	Statut	Dev. Part
							Var. VL (%)	
C cap	FR0010283838	25,529,657.790000	15,976.8730000000	4,762,468.21	1,597.910000	1,593.420000	0.28	VAL EUR
I cap	FR0011720960	35,905,167.580000	27,959.0160000000	4,762,468.21	1,284.200000	1,280.490000	0.29	VAL EUR
X cap	FR0013412301	37,977,633.390000	38,558.0000000000	4,762,468.21	984.940000	982.070000	0.29	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	-19,775.0000000000	EUR							-19,775.00			-0.0200%
4030000	Rachats a regler	Disponibilités	-6,764.0700000000	EUR							-6,764.07			-0.0100%
4130000	Dividendes détachés sur action	Disponibilités	28,531.8000000000	EUR							28,531.80			0.0300%
4161000	Cfde cash donné en garantie	Disponibilités	424,251.3000000000	EUR							424,251.30			0.4300%
4630500	FDG variables N-1 à payer	Disponibilités	-17,270.1100000000	EUR							-17,270.11			-0.0200%
4880010	Prov frais gestion glob 13C	Disponibilités	-30,490.4000000000	EUR							-30,490.40			-0.0300%
4880100	Prov frais gestion glob 1C	Disponibilités	-43,355.4300000000	EUR							-43,355.43			-0.0400%
4880390	Prov frais gestion glob 49C	Disponibilités	-24,184.0100000000	EUR							-24,184.01			-0.0200%
5110300	Cash BP2S BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES	Disponibilités	4,451,524.1300000000	EUR							4,451,524.13			4.4800%
Total devise :			4,762,468.2100000000	EUR							4,762,468.21			4.8000%
Total instrument: Disponibilités											4,762,468.21			4.8000%

  

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
CAZ9 - 52	EURO STOXX BANKS (SX7E) 20/12/2019	Futures	230.0000000000	EUR	A	87.000000	87.20	30/09/2019	Con	1,000,500.00	2,300.00	0.00	2,300.00	0.0000%
VOZ9 - 53	EURO STOXX INSURANCE INDEX (S 20/12/2019)	Futures	45.0000000000	EUR	A	288.100000	288.00	30/09/2019	Con	643,725.00	4,275.00	0.00	4,275.00	0.0000%
VOZ9 - 54	EURO STOXX INSURANCE INDEX (S 20/12/2019)	Futures	5.0000000000	EUR	A	288.200000	288.00	30/09/2019	Con	71,550.00	450.00	0.00	450.00	0.0000%
VOZ9 - 56	EURO STOXX INSURANCE INDEX (S 20/12/2019)	Futures	150.0000000000	EUR	A	288.300000	288.00	30/09/2019	Con	2,147,250.00	12,750.00	0.00	12,750.00	0.0100%
Total devise :				EUR			3,863,025.00			3,863,025.00	19,775.00	0.00	19,775.00	0.0100%
Total instrument: Futures							3,863,025.00			3,863,025.00	19,775.00	0.00	19,775.00	0.0100%
CS1PRB002	Cfde cash donné en garantie	Garanties	424,251.3000000000	EUR		1.000000	1.00	30/09/2019		424,251.30	0.00	0.00	0.00	0.0000%
Total devise :				EUR			424,251.30			424,251.30	0.00	0.00	0.00	0.0000%
Total instrument: Garanties							424,251.30			424,251.30	0.00	0.00	0.00	0.0000%



## Fonds: ROCHE-BRUNE ZONE EURO ACTIONS (PRB002) EUR

Dernière date de VL: 30/09/2019

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
AT000038204	MAYR-MELNHOF KARTON AG	Actions et titres assimilés	14,456,000,000,000,000	EUR		116.225651	110.40	30/09/2019	Con	1,680,158.01	1,595,942.40	0.00	-84,215.61	1,6100%
AT000KAPSCH9	KAPSCO TRAFFICOM AG	Actions et titres assimilés	31,729,000,000,000,000	EUR		32.448704	31.00	30/09/2019	Con	1,029,564.93	983,599.00	0.00	-45,965.93	0,9900%
BE000365676	RECTICEL	Actions et titres assimilés	100,000,000,000,000,000	EUR		9.058850	7.79	30/09/2019	Con	905,855.00	779,000.00	0.00	-126,855.00	0,7800%
BE000379079	BARCO N.V.	Actions et titres assimilés	10,399,000,000,000,000	EUR		104.608022	181.20	30/09/2019	Con	1,087,818.82	1,884,298.80	0.00	796,479.98	1,9000%
DE000520000	BEIERSDORF AG	Actions et titres assimilés	14,795,000,000,000,000	EUR		103.491645	108.20	30/09/2019	Con	1,531,158.89	1,600,819.00	0.00	69,660.11	1,6100%
DE000552004	DEUTSCHE POST AG-REG	Actions et titres assimilés	121,041,000,000,000,000	EUR		28.137678	30.65	30/09/2019	Con	3,405,812.73	3,709,301.45	0.00	303,486.72	3,7300%
DE0005565204	DJERR AG	Actions et titres assimilés	25,492,000,000,000,000	EUR		43.722688	23.81	30/09/2019	Con	1,114,578.25	606,984.52	0.00	-507,613.73	0,6100%
DE0006070006	HOCHTIEF AG	Actions et titres assimilés	9,525,000,000,000,000	EUR		105.669801	104.60	30/09/2019	Con	1,006,504.85	996,315.00	0.00	-10,189.85	1,0000%
DE0006916604	PEIFFER VACUUM TECHNOLOGY	Actions et titres assimilés	11,049,000,000,000,000	EUR		126.217032	124.60	30/09/2019	Con	1,394,571.99	1,376,705.40	0.00	-17,866.59	1,3800%
DE0006969603	PUMA SE	Actions et titres assimilés	19,374,000,000,000,000	EUR		68.425000	71.00	30/09/2019	Con	1,257,240.95	1,304,554.00	0.00	47,313.05	1,3100%
DE0007010803	RATIONAL AG	Actions et titres assimilés	1,703,000,000,000,000	EUR		589.869025	658.00	30/09/2019	Con	1,004,546.95	1,120,574.00	0.00	116,027.05	1,1300%
DE0007472060	WIRECARD AG	Actions et titres assimilés	15,058,000,000,000,000	EUR		140.551146	146.75	30/09/2019	Con	2,116,419.16	2,209,761.50	0.00	93,342.34	2,2200%
DE0007657231	VILLEROY + BOCH AG-PREF	Actions et titres assimilés	89,412,000,000,000,000	EUR		14.352977	12.60	30/09/2019	Con	1,283,328.42	1,126,591.20	0.00	-156,737.22	1,1300%
DE000A009P70	MTU AERO ENGINES AG	Actions et titres assimilés	8,438,000,000,000,000	EUR		207.667309	243.80	30/09/2019	Con	1,752,296.75	2,057,184.40	0.00	304,887.65	2,0700%
ES0109067019	AMADEUS IT GROUP SA	Actions et titres assimilés	17,495,000,000,000,000	EUR		68.714520	65.72	30/09/2019	Con	1,202,160.53	1,149,771.40	0.00	-52,389.13	1,1600%
ES0118594417	INDRA SISTEMAS SA	Actions et titres assimilés	289,982,000,000,000,000	EUR		8.646024	7.94	30/09/2019	Con	2,507,191.21	2,302,457.08	0.00	-204,734.13	2,3200%
ES0130670112	ENDESA SA	Actions et titres assimilés	87,479,000,000,000,000	EUR		21.129892	24.14	30/09/2019	Con	1,848,421.84	2,111,743.06	0.00	263,321.22	2,1200%
ES0148398007	INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	Actions et titres assimilés	90,158,000,000,000,000	EUR		24.274142	28.40	30/09/2019	Con	2,188,508.09	2,560,487.20	0.00	371,979.11	2,5800%
ES0184933812	ZARDOYA OTIS SA	Actions et titres assimilés	435,568,000,000,000,000	EUR		6.259922	6.23	30/09/2019	Con	2,726,311.15	2,713,713.24	0.00	-12,597.91	2,7300%
FI0009003727	WARTSILA OYJ ABP	Actions et titres assimilés	87,000,000,000,000,000	EUR		11.428601	10.28	30/09/2019	Con	994,114.30	899,925.00	0.00	-100,189.30	0,9000%
FI0009013403	KONE OYJ-B	Actions et titres assimilés	47,182,000,000,000,000	EUR		51.871541	52.24	30/09/2019	Con	2,447,403.04	2,464,787.68	0.00	17,384.64	2,4800%
FR0000032658	SYNERGIE SA	Actions et titres assimilés	42,634,000,000,000,000	EUR		25.119841	26.40	30/09/2019	Con	1,070,959.30	1,125,537.60	0.00	54,578.30	1,1300%
FR0000038606	MANITOU BF	Actions et titres assimilés	61,038,000,000,000,000	EUR		29.274616	18.00	30/09/2019	Con	1,786,864.02	1,098,684.00	0.00	-688,180.02	1,1100%



## Fonds: ROCHE-BRUNE ZONE EURO ACTIONS (PRB002) EUR

Dernière date de VL: 30/09/2019

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
FR000044448	NEXANS SA	Actions et titres assimilés	29,399.0000000000	EUR		34.086300	33.86	30/09/2019	Con	1,002,103.13	995,450.14	0.00	-6,652.99	1.0000%
FR0000071946	ALTEN SA	Actions et titres assimilés	25,328.0000000000	EUR		80.296172	104.80	30/09/2019	Con	2,033,741.44	2,654,374.40	0.00	620,632.96	2.6700%
FR0000073793	DEVOTEAM SA	Actions et titres assimilés	21,933.0000000000	EUR		73.556282	76.80	30/09/2019	Con	1,613,309.94	1,694,454.40	0.00	71,144.46	1.6900%
FR0000120172	CARREFOUR SA	Actions et titres assimilés	99,405.0000000000	EUR		17.649264	16.06	30/09/2019	Con	1,754,425.11	1,596,444.30	0.00	-157,980.81	1.6100%
FR0000120271	TOTAL SA	Actions et titres assimilés	49,230.0000000000	EUR		51.462837	47.89	30/09/2019	Con	2,224,738.46	2,070,068.55	0.00	-154,669.91	2.0800%
FR0000121147	FAURECIA	Actions et titres assimilés	39,216.0000000000	EUR		40.547424	43.52	30/09/2019	Con	1,590,107.76	1,706,680.32	0.00	116,572.56	1.7200%
FR0000121329	THALES SA	Actions et titres assimilés	26,778.0000000000	EUR		94.241717	105.50	30/09/2019	Con	2,523,604.69	2,825,079.00	0.00	301,474.31	2.8400%
FR0000121465	KERING	Actions et titres assimilés	3,316.0000000000	EUR		454.965247	467.55	30/09/2019	Con	1,508,664.76	1,550,395.80	0.00	41,731.04	1.5600%
FR0000124141	VEOLIA ENVIRONNEMENT	Actions et titres assimilés	153,172.0000000000	EUR		18.912278	23.26	30/09/2019	Con	2,896,831.48	3,562,780.72	0.00	665,949.24	3.5600%
FR0000130650	DASSAULT SYSTEMES SA	Actions et titres assimilés	15,593.0000000000	EUR		136.930348	130.75	30/09/2019	Con	2,135,154.91	2,038,784.75	0.00	-96,370.16	2.0500%
FR0005691656	TRIGANO SA	Actions et titres assimilés	11,277.0000000000	EUR		74.248822	73.75	30/09/2019	Con	837,303.97	831,678.75	0.00	-5,625.22	0.8400%
FR0010208468	ENGIE	Actions et titres assimilés	141,503.0000000000	EUR		13.996234	14.98	30/09/2019	Con	1,980,509.13	2,119,714.94	0.00	139,205.81	2.1300%
FR0010259150	IPSEN	Actions et titres assimilés	36,183.0000000000	EUR		84.276883	87.10	30/09/2019	Con	3,049,390.45	3,151,539.30	0.00	102,148.85	3.1700%
FR0010307819	LEGRAND SA	Actions et titres assimilés	19,148.0000000000	EUR		65.540000	65.48	30/09/2019	Con	1,254,959.92	1,253,811.04	0.00	-1,148.88	1.2600%
FR0010313833	ARKEMA	Actions et titres assimilés	32,426.0000000000	EUR		96.867638	85.52	30/09/2019	Con	3,141,030.04	2,773,071.52	0.00	-367,958.52	2.7900%
FR0010929125	ID LOGISTICS GROUP	Actions et titres assimilés	11,208.0000000000	EUR		125.034357	161.60	30/09/2019	Con	1,401,385.07	1,811,212.80	0.00	409,827.73	1.8200%
FR0011478928	FNAC DARTY SA	Actions et titres assimilés	28,804.0000000000	EUR		86.267665	58.00	30/09/2019	Con	2,542,461.82	1,670,632.00	0.00	-871,829.82	1.6800%
FR0013176526	VALEO SA	Actions et titres assimilés	38,198.0000000000	EUR		34.347446	29.75	30/09/2019	Con	1,312,003.75	1,136,390.50	0.00	-175,613.25	1.1400%
FR0013199916	SOMFY SA	Actions et titres assimilés	19,719.0000000000	EUR		84.491193	85.00	30/09/2019	Con	1,581,590.64	1,553,677.00	0.00	-27,913.64	1.5600%
FR0013269123	RUBIS	Actions et titres assimilés	44,893.0000000000	EUR		50.699310	53.30	30/09/2019	Con	2,275,774.75	2,392,796.90	0.00	117,022.15	2.4100%
IT0001049623	INDUSTRIA MACCHINE AUTOMATIC	Actions et titres assimilés	24,504.0000000000	EUR		55.964608	64.20	30/09/2019	Con	1,371,356.75	1,573,156.80	0.00	201,800.05	1.5800%
IT0001137345	AUTOGRILL SPA	Actions et titres assimilés	183,492.0000000000	EUR		10.026963	8.89	30/09/2019	Con	1,840,234.43	1,630,326.42	0.00	-209,908.01	1.6400%
IT0001233417	AZA SPA	Actions et titres assimilés	792,729.0000000000	EUR		1.433232	1.68	30/09/2019	Con	1,136,164.50	1,334,955.64	0.00	198,791.14	1.3400%



## Fonds: ROCHE-BRUNE ZONE EURO ACTIONS (PRB002) EUR

Dernière date de VL: 30/09/2019

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
IT0003115950	DELONGHI SPA	Actions et titres assimilés	106,851,000,000,000,000	EUR		21,639,920	17,30	30/09/2019 Con	2,312,182.93	1,848,522.30	0.00	-463,660.63	1,8600%
IT0003428445	MARR SPA	Actions et titres assimilés	71,362,000,000,000,000	EUR		20,537,466	20,10	30/09/2019 Con	1,465,594.68	1,434,376.20	0.00	-31,218.48	1,4400%
IT0005252728	BREMBO SPA	Actions et titres assimilés	145,446,000,000,000,000	EUR		11,383,978	8,94	30/09/2019 Con	1,655,754.06	1,300,287.24	0.00	-355,466.82	1,3100%
		Total devise :		EUR					85,782,167.75	86,273,378.66	0.00	491,210,91	86,7700%
		Total instrument: Actions et titres assimilés		EUR					85,782,167.75	86,273,378.66	0.00	491,210,91	86,7700%
FR0010356717	RB CAPITAL PRUDENCE	OPCVM	9,000,000,000,000	EUR		1,120,980,000	1,123,23	27/09/2019 Con	10,088.82	10,109.07	0.00	20,25	0,0100%
FR0011659945	ROCHE-BRUNE EURO PME-I	OPCVM	5,165,000,000,000,000	EUR		131,646,790	150,55	27/09/2019 Con	679,855.67	777,590.75	0.00	97,635.08	0,7600%
FR0011686930	ROCHE-BRUNE EUROPE ACTIONS-I	OPCVM	1,453,013,000,000,000	EUR		1,342,689,997	1,329,87	27/09/2019 Con	1,950,946.02	1,932,318.40	0.00	-18,627.62	1,9400%
FR0013339587	CBT EURO SD-I	OPCVM	8,334,000,000,000	EUR		96,676,940,245	104,266,67	27/09/2019 Con	805,705.62	868,958.43	0.00	63,252.81	0,8700%
LU1829219390	LYXOR EURO STOXX BANKS DR	OPCVM	58,487,000,000,000,000	EUR		89,837,595	81,52	30/09/2019 Con	5,254,331.41	4,767,860.24	0.00	-486,471.17	4,8000%
		Total devise :		EUR					8,701,027.54	8,356,836.89	0.00	-344,190.65	8,4000%
		Total instrument: OPCVM		EUR					8,701,027.54	8,356,836.89	0.00	-344,190.65	8,4000%
FONDS:	ROCHE-BRUNE ZONE EURO ACTIONS (PRB002)	EUR							98,770,471.59	99,412,458.76	0.00	166,795.26	99,9800%