

**CACEIS BANK**  
1-3 place Valhubert  
F-75013 Paris

Dépositaire

**MONTPENSIER FINANCE**  
58, avenue Marceau  
F-75008 Paris

Société de gestion

Fonds Commun de Placement Général

## RAPPORT SEMESTRIEL AU 29 JUIN 2018

# SAISONNALITE ALL CAPS EURO

- **ETAT DU PATRIMOINE EN EUR**

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier.	
b) Avoirs bancaires	4 334,95
c) Autres actifs détenus par l'OPC	335 302,36
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	339 637,31
e) Passif	-9 267,90
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	330 369,41

\* Les montants sont signés

- **NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART**

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
SAISONNALITE ALL CAPS EURO IC	C	110 140,51	440	250,31
SAISONNALITE ALL CAPS EURO RC	C	60 074,52	400	150,18
SAISONNALITE ALL CAPS EURO ID	D	110 140,51	440	250,31
SAISONNALITE ALL CAPS EURO RD	D	50 013,87	333	150,19

• **ELEMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES**

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
<p>A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-I du code monétaire et financier.</p> <p>Et B) Les titres financiers éligibles et les 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.</p> <p>C) Les titres financiers éligibles et les 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.</p> <p>D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.</p> <p>E) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.</p>		

\* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

\*\* Se reporter au d) de l'état du patrimoine

• **RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE**

<b>Titres</b>	<b>Devise</b>	<b>En montant (EUR)</b>	<b>Pourcentage actif net *</b>	<b>Pourcentage total des actifs **</b>
NEANT				

\* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

\*\* Se reporter au d) de l'état du patrimoine

- **RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR**

Pays	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
NEANT		

\* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

\*\* Se reporter au d) de l'état du patrimoine

• **RÉPARTITION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE**

<b>Nature d'actifs</b>	<b>Pourcentage actif net *</b>	<b>Pourcentage total des actifs **</b>
<b>Organismes de placement collectif</b>		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays		
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE		
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés		
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés		
Autres organismes non européens		
Autres		
<b>TOTAL</b>		

\* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

\*\* Se reporter au d) de l'état du patrimoine

• **MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE EN EUR**

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
<p>A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-I du code monétaire et financier.</p> <p>Et B) Les titres financiers éligibles et les 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.</p> <p>C) Les titres financiers éligibles et les 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.</p> <p>D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.</p> <p>E) Les autres actifs : Il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R. 214-II du code monétaire et financier.</p>		

• **DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE**

	Part	Montant net unitaire €	Crédit d'impôt (1) €	Montant brut unitaire (2) €
Dividendes versés				
	SAISONNALITE ALL CAPS EURO ID			
	SAISONNALITE ALL CAPS EURO RD			
Dividendes à verser				
	SAISONNALITE ALL CAPS EURO ID			
	SAISONNALITE ALL CAPS EURO RD			

(1) Le crédit d'impôt unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

(2) Le montant brut unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

- **INFORMATIONS DIVERSES**

**Etablissement dépositaire :** *Caceis Bank - 1-3 place Valhubert - 75013 - Paris*

Le relevé Périodicité Semestrielle détaillé de l'actif est disponible dans un délai de huit semaines à compter de la fin de la période. Il peut être transmis sur simple demande auprès de la société de gestion :

**Montpensier Finance** - *58 avenue Marceau - 75008 - Paris*



- **TRANSPARENCE DES OPERATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA REUTILISATION DES INSTRUMENTS FINANCIERS – REGLEMENT SFTR – en devise de comptabilité de l'OPC (EUR)**

Au cours de l'exercice, l'OPC n'a pas fait l'objet d'opérations relevant de la réglementation SFTR.

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 29/06/2018 EN EUR**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Organismes de placement collectif</b>				
<b>OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>				
<b>FRANCE</b>				
ADVANCED SMALL CAPS EURO IC	EUR	240	62 256,00	18,85
AMUNDI 3 M E	EUR	1	10 009,56	3,03
LYXOR EURO STOXX 50 (DR) ETF D EU PARTS -D EUR	EUR	1 800	61 065,00	18,48
QUADRATOR IC	EUR	160	61 377,60	18,58
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>194 708,16</b>	<b>58,94</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
AMIS EURST50 UEDREC	EUR	850	61 863,00	18,73
AMUNDI INDEX MSCI EMU UCI ETF DR	EUR	268	53 653,60	16,24
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>115 516,60</b>	<b>34,97</b>
<b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>			<b>310 224,76</b>	<b>93,91</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>310 224,76</b>	<b>93,91</b>
<b>Instruments financiers à terme</b>				
<b>Engagements à terme ferme</b>				
<b>Engagements à terme ferme sur marché réglementé ou assimilé</b>				
EUR XEUR FESX D 0918	EUR	-7	8 150,00	2,47
<b>TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé</b>			<b>8 150,00</b>	<b>2,47</b>
<b>TOTAL Engagements à terme fermes</b>			<b>8 150,00</b>	<b>2,47</b>
<b>TOTAL Instruments financiers à terme</b>			<b>8 150,00</b>	<b>2,47</b>
<b>Appel de marge</b>				
Appels de marges C.A.Indo en euro	EUR	-8 150	-8 150,00	-2,47
<b>TOTAL Appel de marge</b>			<b>-8 150,00</b>	<b>-2,47</b>
<b>Créances</b>			<b>16 927,60</b>	<b>5,12</b>
<b>Dettes</b>			<b>-1 117,90</b>	<b>-0,34</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>4 334,95</b>	<b>1,31</b>
<b>Actif net</b>			<b>330 369,41</b>	<b>100,00</b>