

Rapport semestriel
Fonds Commun de Placement
SCOR CONVERTIBLE EUROPE

30 juin 2017

Société de Gestion

SCOR Investment Partners SE
5 avenue Kléber 75016 Paris

Dépositaire

BNP Paribas Securities Services S.C.A.

Commissaire aux comptes

Deloitte & Associés

TABLE DES MATIERES

ETAT DU PATRIMOINE.....	3
NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION VALEUR NETTE D'INVENTAIRE / PART.....	4
ELEMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES.....	5
VENTILATION DES ACTIFS PAR SECTEUR ECONOMIQUE	6
VENTILATION DES ACTIFS PAR SECTEUR GEOGRAPHIQUE	7
VENTILATION DES ACTIFS PAR DEVISES.....	8
MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE.....	9
DONNEES CHIFFREES RELATIVES AUX DIVIDENDES VERSES OU A VERSER.....	10
INFORMATIONS RELATIVES AUX OPERATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET AUX CONTRATS D'ECHANGE SUR RENDEMENT GLOBAL (REGLEMENT SFTR).....	11

ETAT DU PATRIMOINE

Éléments 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	191 864 068,26
b) avoirs bancaires	8 215 535,85
c) autres actifs détenus par l'OPCVM	207 635 462,32
d) total des actifs détenus par l'OPCVM	407 715 066,43
e) passif	-214 695 940,24
f) valeur nette d'inventaire	193 019 126,19

(*) Les montants sont signés

NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION VALEUR NETTE D'INVENTAIRE / PART

Isin	Part	Actif net par part	Nombre de parts	Valeur liquidative
FR0011368430	C EUR	126 986 829,66	102 360	1 240,59
FR0011668037	C CHF Hedged	43 591 043,02	43 050	1 012,56
FR0011929702	C USD Hedged	22 441 253,51	23 330	961,90

ELEMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres :	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
a) 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 du code monétaire et financier	97.8	46.3
b) 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	-	-
c) 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	1.6	0.76
d) titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R.214-11 du code monétaire et financier	-	-
e) autres actifs : il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R.214-11 du code monétaire et financier	-	-

VENTILATION DES ACTIFS PAR SECTEUR ECONOMIQUE

Secteur économique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
Financier	24,06	11,39
Industriel	15,74	7,45
Energie	12,36	5,85
Consommateur, non cyclique	10,51	4,98
Consommateur, cyclique	9,29	4,40
<i>Autres secteurs</i>	27,43	12,99
Total	99,40	47,06

VENTILATION DES ACTIFS PAR SECTEUR GEOGRAPHIQUE

Secteur géographique	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
France	27,43	12,99
Allemagne	20,68	9,79
Royaume-Uni	14,71	6,97
Italie	8,06	3,81
Espagne	5,44	2,57
<i>Autres pays</i>	23,09	10,93
Total	99,40	47,06

VENTILATION DES ACTIFS PAR DEVISES

Devise	Pourcentage	
	Actif net	Total des actifs
EUR	72,49	34,32
USD	15,12	7,16
GBP	8,83	4,18
SEK	1,70	0,80
CHF	1,27	0,60
<i>Autres devises</i>	-	-
Total	99,40	47,06

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PERIODE

Éléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
a) 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 du code monétaire et financier	59 963 598,34	56 478 575,62
b) 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	-	-
c) 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	1 209 457,00	-
d) titres financiers nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R.214-11 du code monétaire et financier	-	-
e) autres actifs : il s'agit des actifs mentionnés au II de l'article R.214-11 du code monétaire et financier	-	-

Mouvements intervenus au cours de la période	Mouvements (en montant)
Acquisitions	61 173 055,34
Cessions	56 478 575,62

DONNEES CHIFFREES RELATIVES AUX DIVIDENDES VERSES OU A VERSER

Dividendes versés :

Date	Part	Montant brut	Crédit d'impôt	Montant net
-	-	-	-	-

Dividendes à verser :

Date	Part	Montant brut	Crédit d'impôt	Montant net
-	-	-	-	-

INFORMATIONS RELATIVES AUX OPERATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET AUX CONTRATS D'ECHANGE SUR RENDEMENT GLOBAL (REGLEMENT SFTR)

Informations générales

Montant des titres et matières premières prêtés en proportion du total des actifs pouvant être prêtés définis comme excluant la trésorerie et les équivalents de trésorerie

Non applicable.

Montant des actifs engagés dans chaque type d'opération de financement sur titres et de contrats d'échange sur rendement global exprimés en valeur absolue (dans la monnaie de l'organisme de placement collectif) et en proportion des actifs sous gestion de l'organisme de placement collectif

Non applicable.

Données sur la concentration

Dix plus gros émetteurs de garanties pour tous les types d'opérations de financement sur titres et de contrats d'échange sur rendement global (ventilation des volumes de garanties et de matières premières reçus par noms d'émetteurs)

Non applicable.

Dix principales contreparties pour chaque type d'opérations de financement sur titres et de contrats d'échange sur rendement global séparément (nom de la contrepartie et volume brut des opérations en cours)

Non applicable.

Données d'opération agrégées pour chaque type d'opérations de financement sur titres et de contrats d'échange sur rendement global séparément à ventiler en fonction des catégories suivantes

- Type et la qualité des garanties (collateral) :

Non applicable.

- Echéance de la garantie, ventilée en fonction des tranches d'échéance suivantes: moins d'un jour, un jour à une semaine, une semaine à un mois, un à trois mois, trois mois à un an, plus d'un an, opérations ouvertes :

Non applicable.

- Monnaie de la garantie :

Non applicable.

- Echéance des opérations de financement sur titres et des contrats d'échange sur rendement global, ventilée en fonction des tranches d'échéance suivantes: moins d'un jour, un jour à une semaine, une semaine à un mois, un à trois mois, trois mois à un an, plus d'un an, opérations ouvertes :

Non applicable.

- Pays où sont établies les contreparties :

Non applicable.

- Règlement et la compensation :

Non applicable.

Données sur la réutilisation des garanties (collateral)

- Part des garanties reçues qui est réutilisée, par rapport au montant maximal précisé dans le prospectus ou dans les informations à communiquer aux investisseurs :

Non applicable.

- Revenus, pour l'organisme de placement collectif, du réinvestissement des garanties en espèces :

Non applicable.

Conservation des garanties reçues par l'organisme de placement collectif dans le cadre des opérations de financement sur titres et des contrats d'échange sur rendement global (nombre de dépositaires, noms de ceux-ci et montant des actifs en garantie conservés par chacun des dépositaires)

Non applicable.

Conservation des garanties fournies par l'organisme de placement collectif dans le cadre des opérations de financement sur titres et des contrats d'échange sur rendement global (part des garanties détenues sur des comptes séparés ou des comptes groupés, ou sur d'autres comptes)

Non applicable.

Données sur les revenus et les coûts de chaque type d'opération de financement sur titres et de contrat d'échange sur rendement global, ventilées entre l'organisme de placement collectif, le gestionnaire de l'organisme de placement collectif et les tiers, en valeur absolue et en pourcentage des revenus globaux générés par ce type d'opération de financement sur titres et de contrat d'échange sur rendement global

Non applicable.