

**FCP de droit français**

**PREVAAL DIVERSIFIE**

**PLAQUETTE SEMESTRIELLE**

au 30 juin 2020

**Société de Gestion : PREVAAL FINANCE**  
**Dépositaire : Caceis Bank**  
**Commissaire aux comptes : PriceWaterhouseCoopers Audit**

PREVAAL FINANCE - 18 avenue d'Alsace - 92400 - Courbevoie

- **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.	7 556 138,58
b) Avoirs bancaires	410 549,33
c) Autres actifs détenus par l'OPC	10 729 378,15
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	18 696 066,06
e) Passif	-41 801,98
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	18 654 264,08

\* 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
PREVAAL DIVERSIFIE	C/D/R	18 654 264,08	17 293,000	1 078,71

• **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. 422-1 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>	39,45	39,36
<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>	1,06	1,06
<p>D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.</p>		
<p>E) Les autres actifs.</p>	57,14	57,01

\* 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**

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Dollar us	USD	1 065 111,27	5,71	5,70
Euro	EUR	6 272 024,08	33,62	33,55
Franc suisse	CHF	110 379,30	0,59	0,59
Livre sterling	GBP	108 623,93	0,58	0,58
<b>TOTAL</b>		<b>7 556 138,58</b>	<b>40,51</b>	<b>40,42</b>

\* 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**

<b>Pays</b>	<b>Pourcentage actif net *</b>	<b>Pourcentage total des actifs **</b>
France	15,54	15,50
Espagne	8,06	8,04
Allemagne	6,37	6,36
Italie	3,85	3,84
Belgique	1,91	1,90
Autriche	1,58	1,57
Luxembourg	0,94	0,94
Pays-bas	0,68	0,68
Suisse	0,59	0,59
Irlande	0,52	0,52
Iles caimans	0,47	0,47
<b>TOTAL</b>	<b>40,51</b>	<b>40,42</b>

\* 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	57,14	57,01
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		
<b>Autres Actifs</b>		
Autres		
<b>TOTAL</b>	<b>57,14</b>	<b>57,01</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
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. 422-1 du code monétaire et financier. 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.	3 127 751,51	1 190 028,56
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.	86 500,00	200 000,00
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	1 256 208,50	3 007 099,47

• **DISTRIBUTION EN COURS DE PERIODE**

	Part	Montant net unitaire €	Crédit d'impôt (1) €	Montant brut unitaire (2) €
Dividendes versés				
	PREVAAL DIVERSIFIE			
Dividendes à verser				
	PREVAAL DIVERSIFIE			

(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 :

**PREVAAL FINANCE** - 18 avenue d'Alsace - 92400 - Courbevoie

- **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 30/06/2020 EN EUR**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Obligations et valeurs assimilées</b>				
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
BASF 0.925% 09-03-23 EMTN	USD	250 000	218 946,53	1,17
DEUTSCHE POST AG 0.05% 30-06-25	EUR	200 000	197 587,46	1,06
DEUTSCHE WOHNEN AG 0.325% 26-07-24	EUR	100 000	110 165,58	0,59
DEUTSCHE WOHNEN AG 0.6% 05-01-26	EUR	200 000	215 233,16	1,15
FRESENIUS SE ZCP 31-01-24	EUR	200 000	191 795,00	1,03
MTU AERO ENGINES GMBH 0.05% 18-03-27	EUR	300 000	255 094,97	1,37
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>1 188 822,70</b>	<b>6,37</b>
<b>AUTRICHE</b>				
AUSTRIAMICROSYSTEMS AG ZCP 05-03-25	EUR	200 000	138 179,00	0,74
AUSTRIAMICROSYSTEMS AG 0.875% 28-09-22	USD	200 000	156 279,05	0,84
<b>TOTAL AUTRICHE</b>			<b>294 458,05</b>	<b>1,58</b>
<b>BELGIQUE</b>				
AKKA TECHNOLOGIES 3.5% PERP CV	EUR	200 000	157 327,88	0,85
BEKAERT ZCP 09-06-21	EUR	100 000	95 427,00	0,51
ECONOCOM GROUP 0.5% 06-03-23	EUR	15 000	102 742,50	0,55
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>355 497,38</b>	<b>1,91</b>
<b>ESPAGNE</b>				
ALMIRALL 0.25% 14-12-21 CV	EUR	200 000	192 374,96	1,03
CELLNEX TELECOM 0.5% 05-07-28 CV	EUR	100 000	129 296,77	0,69
CELLNEX TELECOM 1.5% 16-01-26 CV	EUR	200 000	341 350,25	1,84
CO ECONIMICA DELTA SA 1.0% 01-12-23	EUR	300 000	289 738,30	1,55
ENCE ENERGIA Y CELULOSA SA 1.25% 05-03-23	EUR	100 000	91 416,11	0,49
INDR SIST 1.25% 07-10-23	EUR	100 000	97 655,13	0,52
INTL CONSOLIDATED AIRLINES GROU 0.625% 17-11-22	EUR	200 000	161 747,65	0,87
TELE ZCP 09-03-21 EMTN	EUR	200 000	199 074,00	1,07
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>1 502 653,17</b>	<b>8,06</b>
<b>FRANCE</b>				
AIR FRANCE KLM 0.125% 25-03-26	EUR	12 400	170 710,80	0,92
AIRBUS GROUP SE ZCP 14-06-21	EUR	300 000	297 190,50	1,59
BIM 2.5% 13-11-20 CV	EUR	5 000	112 812,50	0,60
CIE GEN DES ETS MICHELIN ZCP 10-11-23	USD	200 000	166 723,95	0,89
ELIS EX HOLDELIS ZCP 06-10-23	EUR	5 700	163 732,50	0,88
FIGEAC AERO 1.125% 18-10-22	EUR	4 000	93 752,00	0,50
MAISON DU MONDE SAS 0.125% 06-12-23	EUR	2 000	74 030,00	0,40
NEOEN 2.0% 02-06-25 CV	EUR	3 200	155 427,20	0,83

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2020 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
NEXITY 0.25% 02-03-25 CV	EUR	1 500	84 013,50	0,45
ORANGE 0.375% 27-06-21	GBP	100 000	108 623,93	0,58
PIERRE ET VACANCES 2.0% 01-04-23	EUR	2 000	103 111,00	0,55
REMY COIN 0.125% 07-09-26	EUR	1 800	250 535,70	1,34
T 0.5% 02-12-22 EMTN	USD	200 000	175 689,01	0,94
TECHNIP 0.875% 25-01-21	EUR	100 000	99 472,53	0,53
UNIBAIL RODAMCO ZCP 01/01/22	EUR	1 000	338 658,00	1,83
VALE ELEC ET ZCP 16-06-21 EMTN	USD	400 000	347 472,73	1,87
VALLOUREC 4.125% 04-10-22 CV	EUR	14 000	57 246,00	0,31
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA ZCP 01-01-25	EUR	3 200	99 481,60	0,53
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>2 898 683,45</b>	<b>15,54</b>
<b>ILES CAIMANS</b>				
SIEM INDU 2.25% 02-06-21	EUR	100 000	87 424,60	0,47
<b>TOTAL ILES CAIMANS</b>			<b>87 424,60</b>	<b>0,47</b>
<b>IRLANDE</b>				
GLAN CO OP 1.375% 09-06-21 CV	EUR	100 000	97 652,66	0,52
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>97 652,66</b>	<b>0,52</b>
<b>ITALIE</b>				
ENI ZCP 13-04-22 EMTN	EUR	200 000	196 386,00	1,05
NEXI 1.75% 24-04-27 CV	EUR	200 000	229 172,40	1,23
PRYSMIAN ZCP 17-01-22	EUR	100 000	96 745,50	0,52
TELECOM ITALIA SPA EX OLIVETTI 1.125% 26-03-22	EUR	200 000	196 320,30	1,05
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>718 624,20</b>	<b>3,85</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
CORESTATE CAPITAL HOLDING 1.375% 28-11-22	EUR	100 000	73 444,01	0,39
GRAN CITY PRO 0.25% 02-03-22	EUR	100 000	102 127,06	0,55
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>175 571,07</b>	<b>0,94</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
IBERDROLA INTERNATIONAL BV ZCP 11-11-22 CV	EUR	100 000	126 372,00	0,68
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>126 372,00</b>	<b>0,68</b>
<b>SUISSE</b>				
SIKA AG 0.15% 05-06-25 CV	CHF	100 000	110 379,30	0,59
<b>TOTAL SUISSE</b>			<b>110 379,30</b>	<b>0,59</b>
<b>TOTAL Obligations &amp; val. ass. ng. sur mar. régl. ou ass.</b>			<b>7 556 138,58</b>	<b>40,51</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées</b>			<b>7 556 138,58</b>	<b>40,51</b>

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2020 EN EUR (Suite)**

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>ALLEMAGNE</b>				
ISHARES MSCI WORLD MIN VOL	USD	3 700	160 169,17	0,86
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>160 169,17</b>	<b>0,86</b>
<b>FRANCE</b>				
BDL REMPART EUROPE C	EUR	1 334,3823	183 317,44	0,98
CPR FOCUS INFLATION FCP I	EUR	1 835	242 128,25	1,30
LYXOR STOXX EUROPE 600 DR	EUR	2 700	404 271,00	2,16
MONETA LONG SHORT A	EUR	535	87 114,05	0,47
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>916 830,74</b>	<b>4,91</b>
<b>IRLANDE</b>				
ISHARES EUR CORP ESG 0-3Y D	EUR	150 000	748 515,00	4,01
ISHARES III CORE EUR CORP BOND UCITS ETF EUR DIS	EUR	7 800	1 031 394,00	5,53
SSGA SPDR ETFs Europe I PLC - SPDR Barclays 0-3 Year Euro Co	EUR	10 300	309 463,50	1,66
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>2 089 372,50</b>	<b>11,20</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
AM IS BBB ECIG UEC	EUR	62 800	989 043,48	5,30
AMUNDI INDEX BARCLA EUR CO BBBI-5UCETFDR	EUR	12 200	623 115,00	3,34
BNP ENERGY & METALS EN-UCITS	USD	72 450	526 188,97	2,82
CANDRIAM BONDS TOTAL RETURN I EUR ACC	EUR	240	336 952,80	1,81
EXANE FUNDS 2-EXANE CRISTAL FUND A CAP	EUR	10,485	126 387,03	0,68
LYX COM TH R/CORECM CRS EX-A	USD	4 170	312 058,50	1,67
LYX EUR 2-10Y INFL EXPECTATN	EUR	2 300	214 912,00	1,15
LYXOR ETF EUROMTS 5-7Y INVESTMENT GRADE	EUR	6 300	1 062 684,00	5,70
LYXOR UCITS SMART CASH C-USD	USD	133	127 464,60	0,68
MULTI UNITS LUXEMBOURG LYXOR EURO GOVERNMENT BOND 3 5Y DR UC	EUR	6 800	1 051 824,00	5,64
MULTI UNITS LUXEMBOURG-LYXOR	EUR	5 800	883 827,20	4,74
MULTI UNITS Lyxor EuroMTS I-3Y Investment Grade (DR) UCITS E	EUR	5 500	685 905,00	3,68
SLFL BD INFL.PROTECTION CLI C	EUR	73	551 539,09	2,96
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>7 491 901,67</b>	<b>40,17</b>
<b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>			<b>10 658 274,08</b>	<b>57,14</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>10 658 274,08</b>	<b>57,14</b>
<b>Instruments financiers à terme</b>				
<b>Engagements à terme ferme</b>				
<b>Engagements à terme ferme sur marché réglementé ou assimilé</b>				
E7 USDEUR 0920	USD	10	-4 869,12	-0,03

• **PORTEFEUILLE TITRES AU 30/06/2020 EN EUR (Suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
XEUR FGBL BUN 0920	EUR	8	24 320,00	0,13
<b>TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé</b>			<b>19 450,88</b>	<b>0,10</b>
<b>TOTAL Engagements à terme fermes</b>			<b>19 450,88</b>	<b>0,10</b>
<b>TOTAL Instruments financiers à terme</b>			<b>19 450,88</b>	<b>0,10</b>
<b>Appel de marge</b>				
Appels de marges C.A.Indo en \$ us	USD	5 468,74	4 869,11	0,03
Appels de marges C.A.Indo en euro	EUR	-24 320	-24 320,00	-0,13
<b>TOTAL Appel de marge</b>			<b>-19 450,89</b>	<b>-0,10</b>
<b>Créances</b>			<b>41 914,96</b>	<b>0,22</b>
<b>Dettes</b>			<b>-12 612,86</b>	<b>-0,07</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>410 549,33</b>	<b>2,20</b>
<b>Actif net</b>			<b>18 654 264,08</b>	<b>100,00</b>