

# **AURIS SICAV**

Société d'Investissement à Capital Variable de droit luxembourgeois

## **RAPPORT SEMESTRIEL AU 30 JUIN 2017**

Le prospectus et les documents « Informations Clés pour l'Investisseur » pour la Suisse, les statuts, les rapports semestriel et annuel en français, ainsi que la liste des achats et ventes réalisés pour le Fonds au cours de l'exercice financier peuvent être obtenus gratuitement auprès du représentant en Suisse du Fonds : Carnegie Fund Services S.A., 11, rue du Général-Dufour, 1204 Genève, Suisse, tél. : + 41 22 705 11 78, fax : + 41 22 705 11 79, web : [www.carnegie-fund-services.ch](http://www.carnegie-fund-services.ch). Le service de paiement en Suisse est la Banque Cantonale de Genève, 17, quai de l'Ile, CH-1204 Genève, Suisse. Les derniers prix des parts sont disponibles sur [www.fundinfo.com](http://www.fundinfo.com). Pour les parts du Fonds distribuées aux investisseurs non qualifiés en Suisse et à partir de la Suisse, ainsi que pour les parts du Fonds distribuées aux investisseurs qualifiés en Suisse, le for est à Genève.



AURIS SICAV

Société d'investissement à capital variable

Rapport semestriel non révisé incluant les états financiers

au 30/06/2017

*AURIS SICAV*

**Combinés**

AURIS SICAV  
Combinés  
**États financiers au 30/06/2017**

État des actifs nets au 30/06/2017

*Exprimée en EUR*

Actifs	<b>295.072.715,16</b>
Portefeuille-titres à la valeur de marché	274.212.754,53
<i>Prix d'achat</i>	264.276.567,45
<i>Bénéfices non réalisés sur le portefeuille-titres</i>	9.936.187,08
Avoirs en banque et liquidités	18.055.948,56
Garanties sur contrats à terme	449.303,50
Intérêts à recevoir	687.620,46
Brokers à recevoir	1.186.901,84
Souscriptions à recevoir	11.143,75
Dividendes à recevoir	316.182,52
Plus-value nette non réalisée sur «futures»	152.860,00
Passifs	<b>5.516.430,20</b>
Brokers à payer	2.621.193,60
Taxe d'abonnement à payer	29.013,82
Les commissions de performance	1.502.968,28
Rachats à payer	403.001,20
Moins-value nette non réalisée sur contrats de change à terme	27.851,58
À payer sur change spot	82,59
Compte de marge	145.700,00
Autres passifs	786.619,13
Valeur nette d'inventaire	<b>289.556.284,96</b>

# AURIS SICAV

## Combinés

État des opérations et des variations des actifs nets du 01/01/2017 à 30/06/2017

*Exprimée en EUR*

Revenus	<b>2.580.017,58</b>
Dividendes nets	1.941.034,00
Produits nets d'intérêts sur obligations	638.917,01
Autres produits financiers	66,57
Dépenses	<b>4.228.850,35</b>
L'amortissement des Frais de constitution	5.807,67
Commission de la Société de gestion	1.460.407,06
Commission de dépositaire et conservateur	41.501,94
Taxe d'abonnement	57.332,22
Commission d'administration	35.295,67
Commission de Performance	1.503.086,97
Frais professionnels	19.433,63
Intérêts bancaires et charges similaires	18.471,98
Les frais juridiques	19.433,14
Frais sur transactions	365.567,99
Autres charges	702.512,08
Perte nette sur investissements	<b>-1.648.832,77</b>
Bénéfice/Perte nette réalisée sur :	
- les investissements	4.405.702,40
- options	2.843,00
- contrats de change à terme	103.365,43
- Les instruments financiers à terme	-625.180,40
- devises	-164.434,10
Résultat réalisé	<b>2.073.463,56</b>
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur :	
- les investissements	9.936.187,08
- contrats de change à terme	-27.851,58
- Les instruments financiers à terme	152.860,00
Augmentation de l'actif net résultant des opérations	<b>12.134.659,06</b>
La souscription des Actions de capitalisation	317.164.727,41
Le rachat des Actions de capitalisation	-39.743.101,51
Progression de l'actif net	<b>289.556.284,96</b>
Actifs nets au début de la période	<b>0,00</b>
Actifs nets à la fin de la période	<b>289.556.284,96</b>

*AURIS SICAV*  
**Active Diversified Beta**

La SICAV AURIS Active Diversified Beta

**États financiers au 30/06/2017**

État des actifs nets au 30/06/2017

*Exprimée en EUR*

Actifs	<b>86.520.332,38</b>
Portefeuille-titres à la valeur de marché	78.861.117,22
<i>Prix d'achat</i>	76.800.588,37
<i>Bénéfices non réalisée sur le portefeuille-titres</i>	2.060.528,85
Avoirs en banque et liquidités	5.156.536,41
Garanties sur contrats à terme	449.303,50
Intérêts à recevoir	687.620,46
Brokers à recevoir	1.186.901,84
Souscriptions à recevoir	7.632,00
Dividendes à recevoir	18.360,95
Plus-value nette non réalisée sur «futures»	152.860,00
Passifs	<b>1.501.710,00</b>
Brokers à payer	592.596,00
Taxe d'abonnement à payer	9.919,86
Les commissions de performance	243.427,22
Rachats à payer	360.221,70
À payer sur change spot	82,59
Compte de marge	145.700,00
Autres passifs	149.762,63
Valeur nette d'inventaire	<b>85.018.622,38</b>

# La SICAV AURIS Active Diversified Beta

État des opérations et des variations des actifs nets du 01/01/2017 à 30/06/2017

Exprimée en EUR

Revenus	<b>864.290,44</b>
Dividendes nets	225.365,02
Produits nets d'intérêts sur obligations	638.917,01
Autres produits financiers	8,41
Dépenses	<b>766.762,81</b>
L'amortissement des Frais de constitution	1.786,83
Commission de la Société de gestion	348.733,14
Commission de dépositaire et conservateur	12.608,84
Taxe d'abonnement	19.519,05
Commission d'administration	11.741,75
Commission de Performance	243.427,22
Frais professionnels	6.090,12
Intérêts bancaires et charges similaires	4.851,07
Les frais juridiques	7.719,29
Frais sur transactions	40.492,07
Autres charges	69.793,43
Revenus nets des investissements	<b>97.527,63</b>
Bénéfice/Perte nette réalisée sur :	
- les investissements	198.225,61
- options	2.843,00
- Les instruments financiers à terme	-625.180,40
- devises	-70.082,05
Perte nette réalisée	<b>-396.666,21</b>
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur :	
- les investissements	2.060.528,85
- Les instruments financiers à terme	152.860,00
Augmentation de l'actif net résultant des opérations	<b>1.816.722,64</b>
La souscription des Actions de capitalisation	89.870.219,87
Le rachat des Actions de capitalisation	-6.668.320,13
Progression de l'actif net	<b>85.018.622,38</b>
Actifs nets au début de la période	<b>0,00</b>
Actifs nets à la fin de la période	<b>85.018.622,38</b>



*AURIS SICAV*  
**Evolution Europe**

La SICAV AURIS Evolution Europe  
**États financiers au 30/06/2017**

État des actifs nets au 30/06/2017

*Exprimée en EUR*

Actifs	<b>208.552.382,78</b>
Portefeuille-titres à la valeur de marché	195.351.637,31
<i>Prix d'achat</i>	187.475.979,08
<i>Bénéfices non réalisée sur le portefeuille-titres</i>	7.875.658,23
Avoirs en banque et liquidités	12.899.412,15
Souscriptions à recevoir	3.511,75
Dividendes à recevoir	297.821,57
Passifs	<b>4.014.720,20</b>
Brokers à payer	2.028.597,60
Taxe d'abonnement à payer	19.093,96
Les commissions de performance	1.259.541,06
Rachats à payer	42.779,50
Moins-value nette non réalisée sur contrats de change à terme	27.851,58
Autres passifs	636.856,50
Valeur nette d'inventaire	<b>204.537.662,58</b>

# La SICAV AURIS Evolution Europe

État des opérations et des variations des actifs nets du 01/01/2017 à 30/06/2017

Exprimée en EUR

Revenus	<b>1.715.727,14</b>
Dividendes nets	1.715.668,98
Autres produits financiers	58,16
Dépenses	<b>3.462.087,54</b>
L'amortissement des Frais de constitution	4.020,84
Commission de la Société de gestion	1.111.673,92
Commission de dépositaire et conservateur	28.893,10
Taxe d'abonnement	37.813,17
Commission d'administration	23.553,92
Commission de Performance	1.259.659,75
Frais professionnels	13.343,51
Intérêts bancaires et charges similaires	13.620,91
Les frais juridiques	11.713,85
Frais sur transactions	325.075,92
Autres charges	632.718,65
Perte nette sur investissements	<b>-1.746.360,40</b>
Bénéfice/Perte nette réalisée sur :	
- les investissements	4.207.476,79
- contrats de change à terme	103.365,43
- devises	-94.352,05
Résultat réalisé	<b>2.470.129,77</b>
Variation de la plus- ou moins-value non réalisée sur :	
- les investissements	7.875.658,23
- contrats de change à terme	-27.851,58
Augmentation de l'actif net résultant des opérations	<b>10.317.936,42</b>
La souscription des Actions de capitalisation	227.294.507,54
Le rachat des Actions de capitalisation	-33.074.781,38
Progression de l'actif net	<b>204.537.662,58</b>
Actifs nets au début de la période	<b>0,00</b>
Actifs nets à la fin de la période	<b>204.537.662,58</b>

<b>Compartiment</b>	<b>Date de valeur</b>	<b>ISIN</b>	<b>Classe d'actions</b>	<b>TER sans commission de performance (%)</b>	<b>TER avec commission de performance (%)</b>
ACTIVE DIVERSIFIED BETA	30.06.2017	LU1250158166	C1	3.04	2.04
ACTIVE DIVERSIFIED BETA	30.06.2017	LU1250158596	C2	2.32	1.24
EVOLUTION EUROPE	30.06.2017	LU1250158919	C1	5.46	3.42
EVOLUTION EUROPE	30.06.2017	LU1250159487	C2	4.60	2.40
EVOLUTION EUROPE	30.06.2017	LU1531731500	C5	6.06	3.84