



ATTESTATION DU COMMISSAIRE AUX COMPTES
Composition de l'actif au 29 décembre 2023

ALPHA CONVICTIONS OBLIGATAIRES
OPCVM CONSTITUE SOUS FORME DE FONDS COMMUN DE PLACEMENT
Régi par le Code monétaire et financier

Société de gestion
FINANCIERE DE L'ARC
260, rue Guillaume du Vair
13546 AIX EN PROVENCE

En notre qualité de commissaire aux comptes de l'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement ALPHA CONVICTIONS OBLIGATAIRES, et en application des dispositions de l'article L.214-17 du Code monétaire et financier et de l'article 411-125 du Règlement général de l'Autorité des marchés financiers 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 29 décembre 2023 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'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement 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'OPCVM constitué sous forme de fonds commun de placement acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

En application de la loi, nous vous signalons que nous n'avons pas été en mesure d'émettre la présente attestation dans les délais réglementaires compte tenu du délai nécessaire à la finalisation de nos travaux.

Neuilly sur Seine, date de la signature électronique

Document authentifié par signature électronique

Le commissaire aux comptes
PricewaterhouseCoopers Audit
Frédéric SELLAM

*PricewaterhouseCoopers Audit, 63, rue de Villiers, 92208 Neuilly-sur-Seine Cedex
T: +33 (0) 1 56 57 58 59, F: +33 (0) 1 56 57 58 60, www.pwc.fr*

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 29/12/23

Devise de fixing : FXD Dev. Bloomberg Close

ORTEFEUILLE : F6333 ALPHA CONVICTIONS OBLIGATAIRES VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simpliifie, trame : CLASST COB COMPLET(TL1) , Tris : BVAL)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<-----> PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
-------------	----------------------	-------------------------------	------------	-----------------------------------	--------------	-----------------	--------	------------------------------	--	-------------------	-----------------------------	-----------------

PORTEFEUILLE TITRES

Obligations & Valeurs assimilées

Obligations & valeurs assimilées négo. sur un marché régl. ou assimilé

Obligations à taux fixe négo. sur un marché régl. ou assimilé

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FR0013424876	VIVENDI 1,125%28	EXA-11/12/28	4.	P EUR	87.9294	% 29/12/23	95.015	351,717.44	380,342.79	282.79	28,625.35	1.00
FR001400CKA4	SG TV 06092032	EXA-06/09/32	12.	P EUR	102.1386	% 29/12/23	103.925	1,225,663.19	1,267,583.61	20,483.61	41,920.42	3.32
IT0005445306	ITALY 0,5%150728	EXA-15/07/28	500.	P EUR	85.5634	% 29/12/23	89.851	427,817.10	450,423.50	1,168.50	22,606.40	1.18
XS1428773763	GENERALI 16/48 FLR	EXA-08/06/48	1,100.	P EUR	103.4037	% 29/12/23	103.404	1,137,440.35	1,168,851.10	31,407.10	31,410.75	3.06
XS1550988643	NN GROUP TV130148	EXA-13/01/48	1,150.	P EUR	97.2746	% 29/12/23	100.604	1,118,657.91	1,208,676.31	51,730.31	90,018.40	3.17
XS1615079974	JPMORGAN CHAS TV28	EXA-18/05/28	1,000.	P EUR	92.166	% 29/12/23	94.559	921,659.97	955,883.44	10,293.44	34,223.47	2.51
XS1619568303	URW 17/29 MTN	EXA-29/05/29	600.	P EUR	83.4328	% 29/12/23	90.953	500,596.65	551,103.25	5,385.25	50,506.60	1.45
XS2193662728	BP CAPITAL TVPERP.	EXA-31/12/50	1,400.	P EUR	90.4726	% 29/12/23	93.828	1,266,616.81	1,340,630.93	27,038.93	74,014.12	3.52
XS2199351375	STELLANTIS 4,5%28	EXA-07/07/28	900.	P EUR	106.0579	% 29/12/23	105.429	954,520.86	968,779.03	19,918.03	14,258.17	2.54
XS2346253730	CAIXABANK TV260528	EXA-26/05/28	13.	P EUR	86.8128	% 29/12/23	91.242	1,128,566.08	1,192,059.93	5,913.93	63,493.85	3.13
XS2439004412	PROLOGIS 1%080229	EXA-08/02/29	900.	P EUR	83.2747	% 29/12/23	88.953	749,472.66	808,689.33	8,112.33	59,216.67	2.12
XS2441552192	GOLDM.S.GRP 22/29	EXA-07/02/29	1,000.	P EUR	84.9384	% 29/12/23	89.607	849,383.68	907,371.37	11,301.37	57,987.69	2.38
XS2491664137	EUROFINS SCI 4%29	EXA-06/07/29	450.	P EUR	99.8158	% 29/12/23	101.562	449,171.14	465,930.64	8,901.64	16,759.50	1.22
XS2531420656	ENEL FIN 3,875%29	EXA-09/03/29	650.	P EUR	100.903	% 29/12/23	103.468	655,869.71	693,187.49	20,645.49	37,317.78	1.82
XS2537060746	ARCELORM 4,875%26	EXA-26/09/26	450.	P EUR	104.4383	% 29/12/23	103.265	469,972.34	470,626.41	5,933.91	654.07	1.23
XS2592650373	INTESA SANPAO TV28	EXA-08/03/28	1,100.	P EUR	101.4667	% 29/12/23	103.569	1,116,133.93	1,184,491.24	45,232.24	68,357.31	3.11

Obligations à taux fixe négo. sur un marché régl. ou assimilé

CUMUL (EUR) 13,323,259.82 14,014,630.37 273,748.87 691,370.55 36.75

Obligations à taux variable, révisable négo. sur un marché régl. ou assimilé

DEVISE VALEUR : EUR EURO

XS2524746687	ING GROUP TV240833	EXA-24/08/33	13.	P EUR	97.8145	% 29/12/23	100.501	1,271,588.65	1,325,853.16	19,340.16	54,264.51	3.48
--------------	--------------------	--------------	-----	-------	---------	------------	---------	--------------	--------------	-----------	-----------	------

Obligations à taux variable, révisable négo. sur un marché régl. ou assimilé

CUMUL (EUR) 1,271,588.65 1,325,853.16 19,340.16 54,264.51 3.48

Obligations indexées négo. sur un marché régl. ou assimilé

DEVISE VALEUR : EUR EURO

XS2588885025	UNICREDIT TV160229	EXA-16/02/29	1,200.	P EUR	98.1026	% 29/12/23	102.389	1,177,231.16	1,275,630.74	46,962.74	98,399.58	3.34
--------------	--------------------	--------------	--------	-------	---------	------------	---------	--------------	--------------	-----------	-----------	------

Obligations indexées négo. sur un marché régl. ou assimilé

CUMUL (EUR) 1,177,231.16 1,275,630.74 46,962.74 98,399.58 3.34

Titres subordonnés (TSR - TSDI)

DEVISE VALEUR : EUR EURO

BE0002914951	KBC GROUP TV250433	EXA-25/04/33	13.	P EUR	99.6771	% 29/12/23	102.384	1,295,801.70	1,374,800.40	43,808.40	78,998.70	3.60
FR0013066388	CNP ASS TV15-0647	EXA-10/06/47	11.	P EUR	101.683	% 29/12/23	101.134	1,118,512.57	1,140,469.90	27,995.90	21,957.33	2.99
FR00140005L7	ORANGE TVPERP.	EXA-31/12/50	14.	P EUR	85.6415	% 29/12/23	88.869	1,198,981.10	1,249,521.19	5,355.19	50,540.09	3.28
FR0014000RR2	ENGIE TVPERP.	EXA-31/12/50	13.	P EUR	82.7282	% 29/12/23	88.271	1,075,467.17	1,149,334.47	1,811.47	73,867.30	3.01
FR0014004EF7	GROUPAMA 0,75%28	EXA-07/07/28	15.	P EUR	82.2626	% 29/12/23	88.854	1,233,938.41	1,338,342.79	5,532.79	104,404.38	3.51
FR0014009HA0	BNPP TV310332	EXA-31/03/32	14.	P EUR	90.7936	% 29/12/23	94.763	1,271,110.24	1,353,266.70	26,584.70	82,156.46	3.55
XS1799939027	VOLKSWAGEN INTL18/	EXA-31/12/50	13.	P EUR	95.0915	% 29/12/23	97.119	1,236,189.84	1,293,759.43	31,212.43	57,569.59	3.39
XS1968706108	CREDIT AGRIC 2%29	EXA-25/03/29	15.	P EUR	86.6633	% 29/12/23	92.783	1,299,949.86	1,415,023.69	23,278.69	115,073.83	3.71
XS2290960520	TOTAL TVPERP.	EXA-25/01/50	1,550.	P EUR	83.9199	% 29/12/23	89.708	1,300,758.04	1,414,143.35	23,669.35	113,385.31	3.71

Stock : Stock admi principal au 29/12/23

Devise de fixing : FXD Dev. Bloomberg Close

PORTEFEUILLE : F6333 ALPHA CONVICTIONS OBLIGATAIRES VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : CLASST COB COMPLET(TL1) , Tris : BVAL)

V A L E U R		STATUTS VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<----- PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille			>----- PLUS OU MOINS VAL		PRCT ACT NET
XS2334852253 ENI 2%PERP.		EXA-31/12/50	1,300.	P EUR	86.1807	% 29/12/23	91.456		1,120,349.58	1,205,764.06		16,836.06	85,414.48	3.16	
Titres subordonnés (TSR - TSDI)															
						CUMUL (EUR)			12,151,058.51	12,934,425.98		206,084.98	783,367.47	33.92	
Obligations & valeurs assimilées négo. sur un marché régl. ou assimilé															
						CUMUL (EUR)			27,923,138.14	29,550,540.25		546,136.75	1,627,402.11	77.48	
Obligations & Valeurs assimilées															
						CUMUL (EUR)			27,923,138.14	29,550,540.25		546,136.75	1,627,402.11	77.48	
Titres d'OPC															
OPCVM Français à vocation générale/formule/indiciel/allégé/alternatif/ETF(trackers)															
DEVISE VALEUR : EUR EURO															
FR0013439478 FR.R.G.28 IC EUR3D			1,410.	P EUR	950.8237	M 28/12/23	1040.44		1,340,661.40	1,467,020.40		0.00	126,359.00	3.85	
FR0013505476 TIKEHAU 2027 I 3D			12,950.	P EUR	103.3926	M 28/12/23	112.56		1,338,934.50	1,457,652.00		0.00	118,717.50	3.82	
FR0014008223 CARM I CRDT 27 F 3D			12,640.	P EUR	105.4029	M 28/12/23	115.37		1,332,292.20	1,458,276.80		0.00	125,984.60	3.82	
FR0014008WB9 EDR MIL.WOR.28 I3D			12,730.	P EUR	104.108	M 28/12/23	112.33		1,325,295.40	1,429,960.90		0.00	104,665.50	3.75	
FR001400A1L8 PLUV.CR.OPP.28 I3D			1,300.	P EUR	1034.7204	M 28/12/23	1112.86		1,345,136.50	1,446,718.00		0.00	101,581.50	3.79	
FR001400BJV4 IVO 2028 I SI.3DEC			10,200.	P EUR	107.6998	M 28/12/23	116.43		1,098,538.00	1,187,586.00		0.00	89,048.00	3.11	
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO															
						CUMUL (EUR)			7,780,858.00	8,447,214.10		0.00	666,356.10	22.15	
OPCVM Français à vocation générale/formule/indiciel/allégé/alternatif/ETF(trackers)															
						CUMUL (EUR)			7,780,858.00	8,447,214.10		0.00	666,356.10	22.15	
Titres d'OPC															
						CUMUL (EUR)			7,780,858.00	8,447,214.10		0.00	666,356.10	22.15	
PORTEFEUILLE TITRES															
						CUMUL (EUR)			35,703,996.14	37,997,754.35		546,136.75	2,293,758.21	99.63	
TRESORERIE															
Dettes et créances															
Frais de gestion															
Frais de gestion															
DEVISE VALEUR : EUR EURO															
FGES.EUR Prov frais gestion			-38,982.59	EUR	1.	29/12/23	1.		-38,982.59	-38,982.59		0.00	0.00	-0.10	
Frais de gestion															
						CUMUL (EUR)			-38,982.59	-38,982.59		0.00	0.00	-0.10	
Frais de gestion															
						CUMUL (EUR)			-38,982.59	-38,982.59		0.00	0.00	-0.10	

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 29/12/23
Devise de fixing : FXD Dev. Bloomberg Close
PORTEFEUILLE : F6333 ALPHA CONVICTIONS OBLIGATAIRES VL VALIDEE Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : CLASST COB COMPLET(TL1) , Tris : BVAL)

V A L E U R	STATUTS VAL/LIGNE	QUANTITE ET EXPR. QUANTITE	DEV COT	P.R.U EN DEVISE ET EXPR. COURS	DATE COTA	COURS VALEUR	I F	<----- PRIX REVIENT TOTA	Devise du portefeuille VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA	-----> PLUS OU MOINS VAL	PRCT ACT NET
Dettes et créances												
CUMUL (EUR)								-38,982.59	-38,982.59	0.00	0.00	-0.10
Disponibilités												
Comptes à vue												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
BQ01.EUR	Banque	178,950.09	EUR	1.	29/12/23	1.		178,950.09	178,950.09	0.00	0.00	0.47
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO												
CUMUL (EUR)								178,950.09	178,950.09	0.00	0.00	0.47
Comptes à vue												
CUMUL (EUR)								178,950.09	178,950.09	0.00	0.00	0.47
Disponibilités												
CUMUL (EUR)								178,950.09	178,950.09	0.00	0.00	0.47
TRESORERIE												
CUMUL (EUR)								139,967.50	139,967.50	0.00	0.00	0.37
PORTEFEUILLE : ALPHA CONVICTIONS OBLIGATAIRES (F6333)												
(EUR)								35,843,963.64	38,137,721.85	546,136.75	2,293,758.21	100.00

Stock : Stock admi principal au 29/12/23
 PORTEFEUILLE : F6333 ALPHA CONVICTIONS OBLIGATAIRES

VL VALIDEE

Devise de fixing : FXD Dev. Bloomberg Close
Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : CLASST COB COMPLET(TL1)

```
, Tris : BVAL )
```

Portefeuille titres :	37,997,754.35
-----------------------	---------------

Frais de gestion du jour

C1 Prov frais gestion	:	1,359.58	EUR
-----------------------	---	----------	-----

Part	Devises	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
C1 FR001400EBY9 PART CAPI C	EUR	38,137,721.85	356,046.071	107.11	100.			107.11	107.11

Actif net total en EUR : 38,137,721.85

Other fund - Poids calcule de 0. % (pour un seuil de 0. %)