

Constellation

Fonds Commun de Placement

Société de Gestion :
FINANCIERE DE L'ARC

260, rue Guillaume du Vair
13090 AIX-EN-PROVENCE

Attestation du Commissaire aux Comptes relative à la composition de l'actif

au 29 décembre 2023

Constellation

Fonds Commun de Placement

Société de Gestion :
FINANCIERE DE L'ARC

260, rue Guillaume du Vair
13090 AIX-EN-PROVENCE

Attestation du Commissaire aux Comptes relative à la composition de l'actif

au 29 décembre 2023

En notre qualité de commissaire aux comptes du Fonds Commun de Placement Constellation et en application des dispositions prévues par l'article L 214-17 du Code monétaire et financier 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'OPC 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'OPC acquise dans le cadre de notre mission de certification des comptes annuels.

A Paris La Défense, le 19 février 2024

Le Commissaire aux Comptes

Deloitte & Associés



Virginie GAITTE

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 29/12/23

Devise de fixing : FXD Dev. Bloomberg Close

PORTEFEUILLE : F6330 CONSTELLATION

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
-------------	----------------------	-------------------------------	------------	-----------------------------------	--------------	-----------------	--------	------------------------------	--	-------------------	------------------------------	-----------------

PORTEFEUILLE TITRES

Titres d'OPC

OPCVM Français à vocation générale/formule/indiciel/allégé/alternatif/ETF(trackers)

DEVISE VALEUR : EUR EURO

FR0000979825	CM-AM CAS.1SR IC3D	5.4	P EUR	515558.3463	M 29/12/23	522158.17		2,784,015.07	2,819,654.12	0.00	35,639.05	12.21	
FR0010734376	AR.AC.S.IN.ES.B 3D	2,350.	P EUR	537.9309	M 29/12/23	556.44		1,264,137.50	1,307,634.00	0.00	43,496.50	5.66	
FR0011694264	SOFIDY SEL.1 IC 3D	750.	P EUR	1663.19	M 29/12/23	1679.42		1,247,392.50	1,259,565.00	0.00	12,172.50	5.45	
FR0013535606	H20 MULT.SP IC 4D	3.	P EUR	0.	M 30/11/23	1297.88		0.00	3,893.64	0.00	3,893.64	0.02	
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO													
								CUMUL (EUR)	5,295,545.07	5,390,746.76	0.00	95,201.69	23.34

OPCVM Français à vocation générale/formule/indiciel/allégé/alternatif/ETF(trackers)

CUMUL (EUR) 5,295,545.07 5,390,746.76 0.00 95,201.69 23.34

OPCVM européens coordonnés et assimilables (non français)

DEVISE VALEUR : EUR EURO

LU1797812986	M A.G EU.CI H A.3D	155,000.	P EUR	11.3532	M 29/12/23	11.6786		1,759,746.00	1,810,183.00	0.00	50,437.00	7.84	
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO													
								CUMUL (EUR)	1,759,746.00	1,810,183.00	0.00	50,437.00	7.84

DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US

IE00BQQP9F84	VA GLD MIN USD-A-A	30,000.	P USD	32.62	M 29/12/23	34.695		908,521.44	942,884.32	0.00	34,362.88	4.08	
LU0206982414	CAN.MON.MKT S.I 3D	1,500.	P USD	601.81	M 29/12/23	612.2		839,734.88	831,868.83	0.00	-7,866.05	3.60	
LU1163030197	FOR O VIN V AC	30,000.	P USD	21.5864	M 29/12/23	22.13		593,140.90	601,413.17	0.00	8,272.27	2.60	
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US													
								CUMUL (EUR)	2,341,397.22	2,376,166.32	0.00	34,769.10	10.29

OPCVM européens coordonnés et assimilables (non français)

CUMUL (EUR) 4,101,143.22 4,186,349.32 0.00 85,206.10 18.12

Fonds d'investissements et FCC cotés

Autres OPC

DEVISE VALEUR : EUR EURO

IE000LTA2082	AM.SP GL.I.E.ETF A	110,000.	P EUR	11.902	M 29/12/23	12.303		1,309,220.00	1,353,330.00	0.00	44,110.00	5.86
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US												
IE000C0QKP09	INV NAS 100 USD-AC	50,000.	P EUR	41.2049	M 29/12/23	43.3		2,060,244.37	2,165,000.00	0.00	104,755.63	9.37
IE000LYBU7X5	HSB.MS.W.V.ESG ETF	160,000.	P EUR	15.5971	M 29/12/23	16.6129		2,495,536.00	2,658,064.00	0.00	162,528.00	11.51
IE00BHZRQZ17	FR LIB IND USD-AC	44,000.	P EUR	33.8075	M 29/12/23	35.68		1,487,530.00	1,569,920.00	0.00	82,390.00	6.80
IE00BM8QRZ79	INVESCOM2 SOLAR EN	25,000.	P USD	26.16	M 29/12/23	28.3275		599,175.45	641,532.29	0.00	42,356.84	2.78
IE00BYX2JD69	ISHSIV-MSCI WLD.SR	270,000.	P EUR	9.4803	M 29/12/23	10.085		2,559,674.40	2,722,950.00	0.00	163,275.60	11.79
LU2345046655	AMUN.M.EM.E.CH.E.L	20,000.	P GBP	33.2831	M 29/12/23	34.77		774,430.81	802,159.39	0.00	27,728.58	3.47

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 29/12/23

Devise de fixing : FXD Dev. Bloomberg Close

PORTEFEUILLE : F6330 CONSTELLATION

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
Autres OPC												
					CUMUL (EUR)			11,285,811.03	11,912,955.68	0.00	627,144.65	51.57
Fonds d'investissements et FCC cotés												
					CUMUL (EUR)			11,285,811.03	11,912,955.68	0.00	627,144.65	51.57
Titres d'OPC												
					CUMUL (EUR)			20,682,499.32	21,490,051.76	0.00	807,552.44	93.03
Contrats financiers												
Contrats financiers avec appel de marge												
Engagements à terme fermes												
SOUS-JACENT : CEC EURO FX SPOT												
ECXXH4F00002	EURUSD-CME	0324	ACHLI	03/24	38.	USD	1.1012	M 29/12/23	1.1075	0.00	27,108.43	0.12
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
MARF. EUR	Appels marge futures				12,875.	EUR	1.	29/12/23	1.	12,875.00	12,875.00	0.06
SOUS-JACENT : RTY C RUSSEL 2000 INDEX en Clôture												
RTAXH4F00002	MINI RUSSEL	0324	ACHLI	03/24	15.	USD	1995.41	M 29/12/23	2047.7	0.00	35,526.32	0.15
SOUS-JACENT : SPX C Standard & Poor's 500 en Clôture												
ESXXH4F00002	Mi ni SP500-	0324	ACHLI	03/24	8.	USD	4760.85	M 29/12/23	4820.	0.00	21,433.10	0.09
SOUS-JACENT : SX5E C Euro Stoxx 50 Pr en clôture												
FESXH4F00002	STX50E-EUX	0324	ACHLI	03/24	25.	EUR	4594.5	M 29/12/23	4543.	0.00	-12,875.00	-0.06
DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US												
MARF. USD	Appels marge futures				-92,802.5	USD	0.90473899	29/12/23	0.90587916	-83,962.04	-84,067.85	-0.36
Engagements à terme fermes												
					CUMUL (EUR)			-71,087.04	0.00	0.00	71,087.04	
Contrats financiers avec appel de marge												
					CUMUL (EUR)			-71,087.04	0.00	0.00	71,087.04	
Contrats financiers												
					CUMUL (EUR)			-71,087.04	0.00	0.00	71,087.04	
PORTEFEUILLE TITRES												
					CUMUL (EUR)			20,611,412.28	21,490,051.76	0.00	878,639.48	93.03
TRESORERIE												
Dettes et créances												
SRD et règlements différés												
DEVISE VALEUR : EUR EURO												
AT01. EUR	Ach. titr rgt. différé				-188,037.24	EUR	1.	29/12/23	1.	-188,037.24	-188,037.24	-0.81
VT01. EUR	Vt titr. rég. différé				722,288.57	EUR	1.	29/12/23	1.	722,288.57	722,288.57	3.13
SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO												
					CUMUL (EUR)			534,251.33	534,251.33	0.00	0.00	2.31

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 29/12/23

Devise de fixing : FXD Dev. Bloomberg Close

PORTEFEUILLE : F6330 CONSTELLATION

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
									VALEUR BOURSIERE	COUPON COURU TOTA				
SRD et réglemets différés														
									CUMUL (EUR)	534,251.33	534,251.33	0.00	0.00	2.31
Frais de gestion														
<i>Frais de gestion</i>														
<i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>														
FADM.EUR	Prov frs gest admin.		-31,876.48	EUR	1.	29/12/23	1.		-31,876.48	-31,876.48	0.00	0.00	-0.14	
FGES.EUR	Prov frais gestion		-26,247.49	EUR	1.	29/12/23	1.		-26,247.49	-26,247.49	0.00	0.00	-0.11	
<i>Frais de gestion</i>														
									CUMUL (EUR)	-58,123.97	-58,123.97	0.00	0.00	-0.25
Frais de gestion														
									CUMUL (EUR)	-58,123.97	-58,123.97	0.00	0.00	-0.25
Dettes et créances														
									CUMUL (EUR)	476,127.36	476,127.36	0.00	0.00	2.06
Disponibilités														
Comptes à vue														
<i>DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE</i>														
BQ01.CHF	Banque		3,197.53	CHF	1.02543213	29/12/23	1.07657692		3,278.85	3,442.39	0.00	163.54	0.01	
<i>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : CHF FRANC SUISSE</i>														
									CUMUL (EUR)	3,278.85	3,442.39	0.00	163.54	0.01
<i>DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>														
BQ01.EUR	Banque		975,735.14	EUR	1.	29/12/23	1.		975,735.14	975,735.14	0.00	0.00	4.22	
<i>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : EUR EURO</i>														
									CUMUL (EUR)	975,735.14	975,735.14	0.00	0.00	4.22
<i>DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING</i>														
BQ01.GBP	Banque		27.95	GBP	1.16744186	29/12/23	1.15352228		32.63	32.24	0.00	-0.39	0.00	
<i>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : GBP LIVRE STERLING</i>														
									CUMUL (EUR)	32.63	32.24	0.00	-0.39	
<i>DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</i>														
BQ01.USD	Banque		171,290.85	USD	0.90668626	29/12/23	0.90587916		155,307.06	155,168.81	0.00	-138.25	0.67	
<i>SOUS TOTAL DEVISE VALEUR : USD DOLLAR US</i>														
									CUMUL (EUR)	155,307.06	155,168.81	0.00	-138.25	0.67
Comptes à vue														
									CUMUL (EUR)	1,134,353.68	1,134,378.58	0.00	24.90	4.91

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 29/12/23

PORTEFEUILLE : F6330 CONSTELLATION

VL VALIDEE

Devise de fixing : FXD Dev. Bloomberg Close

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
Disponibilités												
					CUMUL (EUR)			1,134,353.68	1,134,378.58	0.00		24.90 4.91
TRESORERIE												
					CUMUL (EUR)			1,610,481.04	1,610,505.94	0.00		24.90 6.97
PORTEFEUILLE : CONSTELLATION (F6330)												
					(EUR)			22,221,893.32	23,100,557.70	0.00		878,664.38 100.00

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 29/12/23

PORTEFEUILLE : F6330 CONSTELLATION

VL VALIDEE

Devise de fixing : FXD Dev. Bloomberg Close

Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifie, trame : CLASST COB COMPLET(TL1)

, Tris : BVAL)

Portefeuille titres : 21,561,244.61

Frais de gestion du jour

Prov frs gest admin. :	119.24	EUR
C1 Prov frais gestion :	836.81	EUR
S1 Prov frais gestion :	34.5	EUR

Part	Devise	Actif net	Nombre de parts	Valeur liquidative	Coefficient	Coeff resultat	Change	Prix std Souscript.	Prix std Rachat
C1 FR0011175199 PART CAPI C	EUR	21,617,225.32	143,068.403	151.09	93.578895565162			151.09	151.09
S1 FR0013525888 PART CAPI S	EUR	1,483,332.38	1,247.624	1,188.92	6.421104434838			1,188.92	1,188.92
Actif net total en EUR :		23,100,557.70							

Inventaire sur historique de valorisation (HISINV)

Stock : Stock admi principal au 29/12/23

PORTEFEUILLE : F6330 CONSTELLATION

VL VALIDEE

Devise de fixing : FXD Dev. Bloomberg Close

Devise du portefeuille : EUR (Etat simplifié, trame : CLASST COB COMPLET(TL1))

, Tris : BVAL)

COURS DES DEVISES UTILISEES

	par la valorisation		par l'inventaire		par la valorisation précédente	variation		
Cours EUR en CHF :	0.92887	cotation :	29/12/23	0.	0.93458	cotation :	28/12/23	-0.61097
Cours EUR en GBP :	0.86691	cotation :	29/12/23	0.	0.86874	cotation :	28/12/23	-0.21065
Cours EUR en USD :	1.1039	cotation :	29/12/23	0.	1.1061	cotation :	28/12/23	-0.1989

Mixed fund - Poids calculé de 34.38 % (pour un seuil de 25. %)