



SIENNA MONETAIRE ISR

Inventaire au 29/12/2023



Portefeuille

CodeTitre	LibelléTitre	Devise	Quantité	Prix Revient Unitaire	Cours	Prix Reveint Global	VB Coupon Exclu	Coupon Couru	Valeur Boursière	Plus Ou Moins Values	% Poche	% Actif
Autre						0	-31 562,5		-31 562,5	-31 562,5	100,00%	0,00%
Future sur taux						0	-31 562,5		-31 562,5	-31 562,5	100,00%	0,00%
-						0	-31 562,5		-31 562,5	-31 562,5	100,00%	0,00%
CER U4	I EURIBOR 3 0924	EUR	-100	97,284	97,41	0	-31 562,5	0	-31 562,5	-31 562,5	100,00%	0,00%
Offset Future sur taux						0	0		0	0	0,00%	0,00%
-						0	0		0	0	0,00%	0,00%
OFSCER U4	I EURIBOR 3 0924 OFFSET	EUR	24 320 937,5				0			0	0,00%	0,00%
Monétaire & Liquidité						1 643 149 168,72	1 646 546 579,84		1 663 372 933,43	20 223 764,71	100,00%	93,48%
Devise						98 389 949,67	98 246 090,87		98 534 208,86	144 259,19	5,92%	5,54%
-						98 389 949,67	98 246 090,87		98 534 208,86	144 259,19	5,92%	5,54%
CASH EUR	Euro	EUR	98 246 090,87	1	1	98 389 949,67	98 246 090,87	288 117,99	98 534 208,86	144 259,19	5,92%	5,54%
Monétaire						1 379 387 822,94	1 380 538 595,07		1 397 076 830,67	17 689 007,73	83,99%	78,52%
-						1 379 387 822,94	1 380 538 595,07		1 397 076 830,67	17 689 007,73	83,99%	78,52%
FR0128070952	BTF 04/01/24	EUR	17 000 000	99,35	3,45	16 889 546,58	16 991 858,07	0	16 991 858,07	102 311,49	1,02%	0,95%
FR0128070960	BTF 17/01/24	EUR	50 000 000	99,816	3,58	49 908 203,57	49 910 659,92	0	49 910 659,92	2 456,35	3,00%	2,80%
HG0127247452	CARR BQ FLR 03-24	EUR	17 000 000	100	0,15	17 000 000	17 005 595,83	25 511,33	17 031 107,16	31 107,16	1,02%	0,96%
HG0127248021	CARR BQ FLR 04-24	EUR	5 000 000	0	0,16	5 000 000	5 002 222,22	51 728,33	5 053 950,55	53 950,55	0,30%	0,28%
HG0127293951	COVIVIO FLR 04-24	EUR	13 000 000	100	0,35	13 000 000	13 014 029,17	113 672	13 127 701,17	127 701,17	0,79%	0,74%
HG0127318410	ALLI BANQ FLR 04-24	EUR	7 000 000	100	0,09	7 000 000	7 001 680	70 051,92	7 071 731,92	71 731,92	0,43%	0,40%
HG0127318543	CA CONS FI FLR 03-24	EUR	17 000 000	100	0,12	17 000 000	17 005 043,33	3 920,39	17 008 963,72	8 963,72	1,02%	0,96%
HG0127385278	CA CONS FI FLR 04-24	EUR	20 000 000	100	0,07	20 000 000	20 004 588,89	148 813,89	20 153 402,78	153 402,78	1,21%	1,13%
HG0127431080	CA CON 230524	EUR	10 000 000	100	-0,02	10 000 000	9 999 194,44	43 505,83	10 042 700,27	42 700,27	0,60%	0,56%
HG0127431254	CFCM MAIN FLR 05-24	EUR	18 000 000	100	0,11	18 000 000	18 008 030	77 616	18 085 646	85 646	1,09%	1,02%
HG0127436527	ALLI BANQ FLR 06-24	EUR	10 000 000	100	0,08	10 000 000	10 003 555,56	26 692,78	10 030 248,34	30 248,34	0,60%	0,56%
HG0127438697	CA CONS FI FLR 06-24	EUR	18 000 000	100	0,06	18 000 000	18 005 010	32 944	18 037 954	37 954	1,08%	1,01%
HG0127485862	ALLI BANQ FLR 07-24	EUR	7 000 000	100	0,28	7 000 000	7 010 398,89	70 187,44	7 080 586,33	80 586,33	0,43%	0,40%
HG0127494237	AXA BANQUE FLR 07-24	EUR	2 000 000	100	0,14	2 000 000	2 001 563,33	16 850,83	2 018 414,16	18 414,16	0,12%	0,11%
HG0127541698	CARR BQ FLR 10-24	EUR	6 000 000	100	0,15	6 000 000	6 007 300	56 918,33	6 064 218,33	64 218,33	0,36%	0,34%
HG0127748384	SOCIET 100724	EUR	14 000 000	100	0,16	14 000 000	14 012 008,89	281 785,57	14 293 794,46	293 794,46	0,86%	0,80%
HG0127751115	ING BANK N.V. 090224	EUR	14 500 000	100	0,09	14 500 000	14 501 486,25	468 548,51	14 970 034,76	470 034,76	0,90%	0,84%
HG0127752873	JYSKE 070324	EUR	15 000 000	100	0,08	15 000 000	15 002 266,67	459 717,15	15 461 983,82	461 983,82	0,93%	0,87%
HG0127770982	ORANGE SA 080224	EUR	7 000 000	100	0,12	7 000 000	7 000 933,33	229 871,69	7 230 805,02	230 805,02	0,43%	0,41%
HG0127771915	BPIFRANCE SA 040124	EUR	14 000 000	100	0,19	14 000 000	14 000 369,44	483 973	14 484 342,44	484 342,44	0,87%	0,81%
HG0127793877	BNP PAR SE FLR 03-24	EUR	15 000 000	100	0,08	15 000 000	15 002 266,67	459 717,15	15 461 983,82	461 983,82	0,93%	0,87%
HG0127797183	LA BAN 150324	EUR	10 000 000	100	0,08	10 000 000	10 001 688,89	297 436	10 299 124,89	299 124,89	0,62%	0,58%
HG0127797324	LA BAN 220324	EUR	10 000 000	100	0,08	10 000 000	10 001 844,44	291 983,98	10 293 828,42	293 828,42	0,62%	0,58%
HG0127815969	BFCM BANQ FLR 01-25	EUR	19 000 000	100	0,12	19 000 000	19 024 510	162 741,86	19 187 251,86	187 251,86	1,15%	1,08%
HG0127839837	BNP PA 190424	EUR	15 000 000	100	0,1	15 000 000	15 004 625	406 331,7	15 410 956,7	410 956,7	0,93%	0,87%

Portefeuille

CodeTitre	LibelléTitre	Devise	Quantité	Prix Revient Unitaire	Cours	Prix Reveint Global	VB Coupon Exclu	Coupon Couru	Valeur Boursière	Plus Ou Moins Values	% Poche	% Actif
Monétaire & Liquidité						1 643 149 168,72	1 646 546 579,84		1 663 372 933,43	20 223 764,71	100,00%	93,48%
Monétaire						1 379 387 822,94	1 380 538 595,07		1 397 076 830,67	17 689 007,73	83,99%	78,52%
-						1 379 387 822,94	1 380 538 595,07		1 397 076 830,67	17 689 007,73	83,99%	78,52%
HG0127851410	CRED MUNI FLR 02-25	EUR	14 000 000	100	0,03	14 000 000	14 004 795	80 001,83	14 084 796,83	84 796,83	0,85%	0,79%
HG0127897595	LA BAN 150524	EUR	14 000 000	100	0,09	14 000 000	14 004 795	348 803,89	14 353 598,89	353 598,89	0,86%	0,81%
HG0127903872	BARCLA 090524	EUR	13 500 000	100	0,09	13 500 000	13 504 421,25	350 275,89	13 854 697,14	354 697,14	0,83%	0,78%
HG0127904656	SOCIET 220524	EUR	14 000 000	100	0,1	14 000 000	14 005 600	341 471,03	14 347 071,03	347 071,03	0,86%	0,81%
HG0127952218	ORANGE SA 170424	EUR	14 000 000	100	0,09	14 000 000	14 003 815	346 996,11	14 350 811,11	350 811,11	0,86%	0,81%
HG0127953760	CAISSE 310524	EUR	7 000 000	100	0,11	7 000 000	7 003 272,5	168 189,36	7 171 461,86	171 461,86	0,43%	0,40%
HG0127991604	NCP 31/07/24 BNPP EUR V ESTR OIS +0.23	EUR	21 000 000	100	0,06	21 000 000	21 007 490	359 170,36	21 366 660,36	366 660,36	1,28%	1,20%
HG0128001023	COOPER 230524	EUR	19 000 000	100	0,07	19 000 000	19 005 356,94	455 103,6	19 460 460,54	460 460,54	1,17%	1,09%
HG0128001064	COOPER 260624	EUR	16 500 000	100	0,09	16 500 000	16 507 383,75	347 405,69	16 854 789,44	354 789,44	1,01%	0,95%
HG0128001296	ALLIAN 030524	EUR	3 000 000	100	0,13	3 000 000	3 001 354,17	77 122,91	3 078 477,08	78 477,08	0,19%	0,17%
HG0128001536	BPIFRANCE SA 090424	EUR	5 000 000	100	0,09	5 000 000	5 001 262,5	125 136,52	5 126 399,02	126 399,02	0,31%	0,29%
HG0128017110	AXA BANQUE 160224	EUR	6 500 000	100	0,1	6 500 000	6 500 866,67	160 908,56	6 661 775,23	161 775,23	0,40%	0,37%
HG0128020353	ORANGE SA 070624	EUR	14 000 000	100	0,06	14 000 000	14 003 733,33	318 912,01	14 322 645,34	322 645,34	0,86%	0,80%
HG0128037308	PSA BA 240524	EUR	14 000 000	100	0,1	14 000 000	14 005 677,78	350 101,7	14 355 779,48	355 779,48	0,86%	0,81%
HG0128043645	LA BAN 270624	EUR	6 000 000	100	0,08	6 000 000	6 002 400	124 469,34	6 126 869,34	126 869,34	0,37%	0,34%
HG0128045210	LA BAN 120924	EUR	10 000 000	100	0,04	10 000 000	10 002 855,56	125 214,05	10 128 069,61	128 069,61	0,61%	0,57%
HG0128072206	ALLIAN 040725	EUR	7 000 000	100	0,08	7 000 000	7 008 586,67	72 927,75	7 081 514,42	81 514,42	0,43%	0,40%
HG0128072388	CA CON 040725	EUR	6 000 000	100	0,15	6 000 000	6 013 800	63 410,67	6 077 210,67	77 210,67	0,37%	0,34%
HG0128103977	NCP 09/08/24 CACHAPER EUR V ESTR OIS +0.	EUR	20 000 000	100	0,11	20 000 000	20 013 627,78	331 186,6	20 344 814,38	344 814,38	1,22%	1,14%
HG0128104116	NCP 29/08/24 CA ALPES EUR V ESTR OIS +0.	EUR	5 000 000	100	0,07	5 000 000	5 002 362,5	71 222,41	5 073 584,91	73 584,91	0,31%	0,29%
HG0128104249	CRCAM 120924	EUR	15 600 000	100	0,05	15 600 000	15 605 568,33	199 584,92	15 805 153,25	205 153,25	0,95%	0,89%
HG0128104504	CRCAM 111024	EUR	12 000 000	100	0,02	12 000 000	12 001 906,67	111 085,32	12 112 991,99	112 991,99	0,73%	0,68%
HG0128140946	BPCE S.A. 260724	EUR	15 000 000	100	0,07	15 000 000	15 006 095,83	267 860,02	15 273 955,85	273 955,85	0,92%	0,86%
HG0128142215	NCP 01/03/24 ZAXAP EUR V ESTR OIS +0.21	EUR	11 000 000	100	0,09	11 000 000	11 001 705	187 214,08	11 188 919,08	188 919,08	0,67%	0,63%
HG0128151000	VEOLIA 060324	EUR	11 000 000	99,001	4,085	10 890 163,61	10 916 994,33	0	10 916 994,33	26 830,72	0,66%	0,61%
HG0128151935	VEOLIA 290124	EUR	6 000 000	98,959	3,903	5 937 520,79	5 980 547,77	0	5 980 547,77	43 026,98	0,36%	0,34%
HG0128152016	ENGIE SA 310124	EUR	10 000 000	100	-0,02	10 000 000	9 999 822,22	66 735	10 066 557,22	66 557,22	0,61%	0,57%
HG0128153295	NCP 09/08/24 RABBKNA EUR V ESTR OIS +0.2	EUR	22 000 000	100	0,02	22 000 000	22 002 725,56	359 098,59	22 361 824,15	361 824,15	1,34%	1,26%
HG0128153857	NCP 02/08/24 ALVG EUR V ESTR OIS +0.23	EUR	5 000 000	100	0,07	5 000 000	5 002 100	83 909,42	5 086 009,42	86 009,42	0,31%	0,29%
HG0128168814	NCP 11/01/24 AXA BQ EUR V ESTR OIS +0.14	EUR	17 000 000	100	0,07	17 000 000	17 000 396,67	266 281,4	17 266 678,07	266 678,07	1,04%	0,97%
HG0128170547	CREDIT 130325	EUR	12 000 000	100	0,01	12 000 000	12 001 463,33	24 582	12 026 045,33	26 045,33	0,72%	0,68%
HG0128195304	LA BAN 221124	EUR	3 000 000	100	0,03	3 000 000	3 000 820	12 794,23	3 013 614,23	13 614,23	0,18%	0,17%
HG0128198613	ALLIAN 120824	EUR	2 000 000	100	0,02	2 000 000	2 000 251,11	24 764,64	2 025 015,75	25 015,75	0,12%	0,11%
HG0128201961	NCP 20/09/24 78118 EUR V ESTR OIS +0.2	EUR	5 000 000	100	0,06	5 000 000	5 002 208,33	57 252,5	5 059 460,83	59 460,83	0,30%	0,28%
HG0128230952	AXPO I 090124	EUR	1 000 000	98,901	4,28	989 005,55	998 812,48	0	998 812,48	9 806,93	0,06%	0,06%

Portefeuille

CodeTitre	LibelléTitre	Devise	Quantité	Prix Revient Unitaire	Cours	Prix Reveint Global	VB Coupon Exclu	Coupon Couru	Valeur Boursière	Plus Ou Moins Values	% Poche	% Actif
Monétaire & Liquidité						1 643 149 168,72	1 646 546 579,84		1 663 372 933,43	20 223 764,71	100,00%	93,48%
Monétaire						1 379 387 822,94	1 380 538 595,07		1 397 076 830,67	17 689 007,73	83,99%	78,52%
-						1 379 387 822,94	1 380 538 595,07		1 397 076 830,67	17 689 007,73	83,99%	78,52%
HG0128268382	ALLIAN 181024	EUR	4 000 000	100	0,02	4 000 000	4 000 651,11	32 712,22	4 033 363,33	33 363,33	0,24%	0,23%
HG0128268507	JYSKE 181024	EUR	6 000 000	96,001	3,627	5 760 049,15	5 827 974,67	0	5 827 974,67	67 925,52	0,35%	0,33%
HG0128272129	BPI FRANCE E 231024	EUR	7 000 000	96,017	3,542	6 721 204,44	6 800 628,84	0	6 800 628,84	79 424,4	0,41%	0,38%
HG0128293455	BANQUE 251024	EUR	15 000 000	95,992	3,656	14 398 725,23	14 556 562,62	0	14 556 562,62	157 837,39	0,88%	0,82%
HG0128295674	AXA BANQUE E 300424	EUR	8 000 000	97,989	3,931	7 839 098,16	7 894 828,18	0	7 894 828,18	55 730,02	0,47%	0,44%
HG0128308709	COOPER 061124	EUR	14 000 000	100	0	14 000 000	14 000 000	85 192,38	14 085 192,38	85 192,38	0,85%	0,79%
HG0128309327	KERING 060224	EUR	4 600 000	98,989	3,983	4 553 511,18	4 580 742,18	0	4 580 742,18	27 231	0,28%	0,26%
HG0128309491	CAISSE 061125	EUR	18 000 000	100	0,02	18 000 000	18 006 770	119 448	18 126 218	126 218	1,09%	1,02%
HG0128310044	AXA BANQUE E 100624	EUR	18 000 000	100	0,01	18 000 000	18 000 815	106 933,06	18 107 748,06	107 748,06	1,09%	1,02%
HG0128310291	BPCE (ISSUER) 081124	EUR	4 000 000	100	0,03	4 000 000	4 001 046,67	23 871,4	4 024 918,07	24 918,07	0,24%	0,23%
HG0128323161	ALLIAN 101125	EUR	10 000 000	100	0	10 000 000	10 000 000	59 902,78	10 059 902,78	59 902,78	0,60%	0,57%
HG0128323831	SOCIET 081124	EUR	4 000 000	100	0,03	4 000 000	4 001 046,67	23 402,11	4 024 448,78	24 448,78	0,24%	0,23%
HG0128323989	PSA BA 081124	EUR	7 000 000	100	0,03	7 000 000	7 001 831,67	41 245,36	7 043 077,03	43 077,03	0,42%	0,40%
HG0128326222	PSA BANQ F FLR 11-25	EUR	11 700 000	100	0,03	11 695 444,8	11 706 708	69 846,4	11 776 554,4	81 109,6	0,71%	0,66%
HG0128328111	BPCE (ISSUER) 221124	EUR	5 000 000	100	0,03	5 000 000	5 001 366,67	21 046,3	5 022 412,97	22 412,97	0,30%	0,28%
HG0128348457	ALLIAN 011225	EUR	10 000 000	100	0,01	10 000 000	10 001 950	34 679,17	10 036 629,17	36 629,17	0,60%	0,56%
HG0128348994	DASSAU 040324	EUR	4 000 000	99,006	3,968	3 960 257,71	3 971 549,02	0	3 971 549,02	11 291,31	0,24%	0,22%
HG0128349265	BPI FRANCE E 041224	EUR	18 500 000	100	0	18 500 000	18 500 000	55 142,24	18 555 142,24	55 142,24	1,12%	1,04%
HG0128350404	SOCIET 090625	EUR	20 000 000	100	0,01	20 000 000	20 002 927,78	53 115,58	20 056 043,36	56 043,36	1,21%	1,13%
HG0128351279	BANQUE 061224	EUR	10 000 000	100	0	10 000 000	10 000 000	25 824,46	10 025 824,46	25 824,46	0,60%	0,56%
HG0128351287	CAISSE 061224	EUR	12 000 000	100	0	12 000 000	12 000 000	30 989,35	12 030 989,35	30 989,35	0,72%	0,68%
HG0128355437	SOCIET 190625	EUR	18 000 000	100	0	18 000 000	18 000 000	24 152,48	18 024 152,48	24 152,48	1,08%	1,01%
HG0128355932	BPCE (ISSUER) 181224	EUR	12 000 000	100	0	12 000 000	12 000 000	15 404,99	12 015 404,99	15 404,99	0,72%	0,68%
HG0128356799	BPCE (ISSUER) 201224	EUR	17 000 000	100	0	17 000 000	17 000 000	15 867,91	17 015 867,91	15 867,91	1,02%	0,96%
HG0128357722	BPI FRANCE E 030124	EUR	85 000 000	99,934	3,849	84 943 940,65	84 963 660,73	0	84 963 660,73	19 720,08	5,11%	4,77%
HG2573960619	NORDEA 050124	EUR	16 000 000	100	0,16	16 000 000	16 000 426,67	565 517,48	16 565 944,15	565 944,15	1,00%	0,93%
HG2574080433	NATION 050124	EUR	15 500 000	100	0,28	15 500 000	15 500 723,33	548 809,63	16 049 532,96	549 532,96	0,96%	0,90%
HG2575154781	DNB BANK ASA 080124	EUR	16 000 000	100	0,12	16 000 000	16 000 480	542 020,31	16 542 500,31	542 500,31	0,99%	0,93%
HG2577131993	BANK OF MO FLR 01-24	EUR	18 500 000	100	0,12	18 500 000	18 500 801,67	641 544,15	19 142 345,82	642 345,82	1,15%	1,08%
HG2604735733	NORDEA 220324	EUR	12 000 000	100	0,11	12 000 000	12 003 043,33	356 000,77	12 359 044,1	359 044,1	0,74%	0,69%
HG2610525474	NORDEA BKP FLR 04-24	EUR	16 500 000	100	0,11	16 500 000	16 505 041,67	472 754,79	16 977 796,46	477 796,46	1,02%	0,95%
HG2610895489	THE TO 050424	EUR	17 000 000	100	0,1	17 000 000	17 004 580,56	494 674,03	17 499 254,59	499 254,59	1,05%	0,98%
HG2621468805	LLOYDS 070524	EUR	14 000 000	100	0,1	14 000 000	14 005 016,67	365 004,48	14 370 021,15	370 021,15	0,86%	0,81%
HG2662501423	NCP 31/07/24 TORDOMBK EUR V ESTR OIS +0	EUR	7 000 000	100	0,05	7 000 000	7 002 080,56	123 984,96	7 126 065,52	126 065,52	0,43%	0,40%
HG2677568482	NCP 30/08/24 NORBALT EUR V ESTR OIS +0.2	EUR	19 000 000	100	0,1	19 000 000	19 012 877,78	264 505,33	19 277 383,11	277 383,11	1,16%	1,08%

Portefeuille

CodeTitre	LibelléTitre	Devise	Quantité	Prix Revient Unitaire	Cours	Prix Reveint Global	VB Coupon Exclu	Coupon Couru	Valeur Boursière	Plus Ou Moins Values	% Poche	% Actif
Monétaire & Liquidité						1 643 149 168,72	1 646 546 579,84		1 663 372 933,43	20 223 764,71	100,00%	93,48%
Monétaire						1 379 387 822,94	1 380 538 595,07		1 397 076 830,67	17 689 007,73	83,99%	78,52%
-						1 379 387 822,94	1 380 538 595,07		1 397 076 830,67	17 689 007,73	83,99%	78,52%
HG2685980901	THE TORO B FLR 09-24	EUR	22 000 000	100	0,06	22 000 000	22 009 460	274 391,04	22 283 851,04	283 851,04	1,34%	1,25%
HG2685982519	BANK O 100924	EUR	17 000 000	100	0,03	17 000 000	17 003 612,5	215 952,22	17 219 564,72	219 564,72	1,04%	0,97%
HG2704381305	DEUTSC 091024	EUR	17 000 000	95,889	3,784	16 301 151,52	16 507 254,48	0	16 507 254,48	206 102,96	0,99%	0,93%
HG2720903512	NORDEA 121124	EUR	13 000 000	100	0,03	13 000 000	13 003 445	69 291,76	13 072 736,76	72 736,76	0,79%	0,73%
HG2725833748	THE TORO B FLR 11-24	EUR	17 000 000	100	0,03	17 000 000	17 004 646,67	71 387,42	17 076 034,09	76 034,09	1,03%	0,96%
HG2732254128	BANK O 061224	EUR	18 000 000	100	0	18 000 000	18 000 000	50 477,04	18 050 477,04	50 477,04	1,09%	1,01%
HG2733026624	NATL AUST FLR 12-24	EUR	17 000 000	100	0,04	17 000 000	17 006 441,11	45 574,31	17 052 015,42	52 015,42	1,03%	0,96%
HG2739605207	ROYAL 191224	EUR	22 000 000	100	0	22 000 000	22 000 000	22 443,03	22 022 443,03	22 443,03	1,32%	1,24%
HG2739609290	ROYAL 201224	EUR	17 000 000	100	0	17 000 000	17 000 000	15 414,58	17 015 414,58	15 414,58	1,02%	0,96%
OPCVM Monétaire						165 371 396,11	167 761 893,9		167 761 893,9	2 390 497,79	10,09%	9,43%
OPCVM COURT TERME						165 371 396,11	167 761 893,9		167 761 893,9	2 390 497,79	10,09%	9,43%
FR0007435920	AMUNDI EURO LIQ SHORT TERM SRI SRI-I	EUR	7 500	10 982,614	11 143,517	82 369 608,45	83 576 377,5	0	83 576 377,5	1 206 769,05	5,02%	4,70%
FR0010017731	ALLIANZ SECURICA-SRI	EUR	680	122 061,452	123 802,23	83 001 787,66	84 185 516,4	0	84 185 516,4	1 183 728,74	5,06%	4,73%
Obligation						116 105 129,16	115 170 029,99		116 008 384,63	-96 744,53	100,00%	6,52%
Obligation Taux Fixe						12 000 000	12 000 000		12 024 277,7	24 277,7	10,37%	0,68%
-						12 000 000	12 000 000		12 024 277,7	24 277,7	10,37%	0,68%
HG0128345909	RENAUL 4.625% 10/26 EMTN	EUR	12 000 000	100	0	12 000 000	12 000 000	24 277,7	12 024 277,7	24 277,7	10,37%	0,68%
Obligation Taux Variable						104 105 129,16	103 170 029,99		103 984 106,93	-121 022,23	89,63%	5,84%
-						104 105 129,16	103 170 029,99		103 984 106,93	-121 022,23	89,63%	5,84%
CH1160190273	UBS FRN 05/24	EUR	20 000 000	101,404	100,184	20 280 880	20 036 800	163 412,22	20 200 212,22	-80 667,78	17,41%	1,14%
XS2436885748	CM FRN 01/24 EMTN	EUR	9 000 000	100,964	100,041	9 086 760	9 003 708,18	80 919,75	9 084 627,93	-2 132,07	7,83%	0,51%
XS2451397645	SRBANK FRN 03/24 EMTN	EUR	17 000 000	101,276	100,104	17 216 875,46	17 017 641,58	70 323,33	17 087 964,91	-128 910,55	14,73%	0,96%
XS2468133298	MIZUHO FRN 04/24 EMTN	EUR	9 000 000	101,169	100,099	9 105 228	9 008 910	100 380	9 109 290	4 062	7,85%	0,51%
XS2469909217	ISPIM FRN 04/24 998	EUR	15 000 000	100,752	100,043	15 112 845	15 006 525	150 264,58	15 156 789,58	43 944,58	13,07%	0,85%
XS2481275381	OPBANK FRN 05/24 EMTN	EUR	18 000 000	101,467	100,335	18 264 060	18 060 258,78	117 359	18 177 617,78	-86 442,22	15,67%	1,02%
XS2486812683	VLVY FRN 05/24 EMTN	EUR	5 000 000	100,644	100,192	5 032 200	5 009 583,75	22 218,06	5 031 801,81	-398,19	4,34%	0,28%
XS2499418593	BBVASM FRN 07/24 GMTN	EUR	10 000 000	100,063	100,266	10 006 280,7	10 026 602,7	109 200	10 135 802,7	129 522	8,74%	0,57%
Total						1 759 254 297,88	1 761 685 047,33	17 664 708,23	1 779 349 755,56	20 095 457,68		