



# SIENNA SOUVERAIN 5-7 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	348 599,77		348 599,77	348 599,77	100,00%	0,15%
Future sur obligation						0	348 599,77		348 599,77	348 599,77	100,00%	0,15%
-						0	348 599,77		348 599,77	348 599,77	100,00%	0,15%
FBOL0000011J	EURO BUND 0324	EUR	132	134,07	137,22	0	415 800	0	415 800	415 800	119,28%	0,18%
FBOL0000011M	EURO BTP 0324	EUR	-70	115,443	119,15	0	-259 520,23	0	-259 520,23	-259 520,23	-74,45%	-0,11%
FBOL00000120	EURO BOBL 0324	EUR	24	117,85	119,28	0	34 320	0	34 320	34 320	9,85%	0,02%
FBOL00000122	EURO SCHATZ 0324	EUR	400	106,15	106,545	0	158 000	0	158 000	158 000	45,32%	0,07%
Offset Future sur obligation						0	0		0	0	0,00%	0,00%
-						0	0		0	0	0,00%	0,00%
OFSFBOL0000011J	EURO BUND 0324 OFFSET	EUR	-17 697 240				0		0	0	0,00%	0,00%
OFSFBOL0000011M	EURO BTP 0324 OFFSET	EUR	8 080 979,77				0		0	0	0,00%	0,00%
OFSFBOL00000120	EURO BOBL 0324 OFFSET	EUR	-2 828 400				0		0	0	0,00%	0,00%
OFSFBOL00000122	EURO SCHATZ 0324 OFFSET	EUR	-42 460 000				0		0	0	0,00%	0,00%
Monétaire & Liquidité						19 982 654,06	20 232 858,85		20 232 858,85	250 204,79	100,00%	8,88%
Devise						817 714,28	817 458,11		817 458,11	-256,17	4,04%	0,36%
-						817 714,28	817 458,11		817 458,11	-256,17	4,04%	0,36%
CASH EUR	Euro	EUR	817 458,11	1	1	817 714,28	817 458,11	0	817 458,11	-256,17	4,04%	0,36%
OPCVM Monétaire						19 164 939,78	19 415 400,74		19 415 400,74	250 460,96	95,96%	8,52%
-						6 000 977,01	6 178 156,29		6 178 156,29	177 179,28	30,54%	2,71%
FR001400EBN2	SIENNA TRES PLUS PART A	EUR	5 933,865	1 011,31	1 041,169	6 000 977,01	6 178 156,29	0	6 178 156,29	177 179,28	30,54%	2,71%
OPCVM COURT TERME						13 163 962,77	13 237 244,45		13 237 244,45	73 281,68	65,42%	5,81%
FR0007081278	SIENNA MONETAIRE ISR A	EUR	109 294	120,445	121,116	13 163 962,77	13 237 244,45	0	13 237 244,45	73 281,68	65,42%	5,81%
Obligation						213 988 079,78	204 910 763,49		207 323 179,99	-6 664 899,79	100,00%	90,97%
Obligation Taux Fixe						192 451 536,78	183 471 981,61		185 574 809,65	-6 876 727,13	89,51%	81,43%
-						104 017 825,95	107 040 666,85		108 048 886,73	4 031 060,78	52,12%	47,41%
DE0001030583	DBRI IE IE 0.1% 04/33 I/L	EUR	2 000 000	115,39	100,604	2 307 808,08	2 390 501,26	1 437,16	2 391 938,42	84 130,34	1,15%	1,05%
DE0001102556	DBR % 11/28	EUR	11 000 000	87,432	91,271	9 617 480	10 039 795,04	0	10 039 795,04	422 315,04	4,84%	4,41%
DE0001102622	DBR 2.1% 11/29	EUR	14 000 000	97,059	101,011	13 588 260	14 141 494,08	39 360,66	14 180 854,74	592 594,74	6,84%	6,22%
DE000A351ZT4	DBOERS 3.875% 09/33	EUR	700 000	97,48	106,524	682 360	745 669,69	7 188,87	752 858,56	70 498,56	0,36%	0,33%
DE000BU22015	BKO 2.8% 06/25	EUR	20 000 000	99,086	100,191	19 817 200	20 038 155,2	384 236,54	20 422 391,74	605 191,74	9,85%	8,96%
DE000BU2Z015	DBR 2.6% 08/33	EUR	11 000 000	100,16	104,991	11 017 620	11 548 971,5	135 254,3	11 684 225,8	666 605,8	5,64%	5,13%
EU000A3KTGV8	EU 0% 07/26 NGEU	EUR	10 000 000	101,984	94,039	10 198 430	9 403 946,3	0	9 403 946,3	-794 483,7	4,54%	4,13%
FR001400E946	CMARK 4.25% 12/32 EMTN	EUR	1 200 000	99,187	105,32	1 190 244	1 263 844,08	4 598,36	1 268 442,44	78 198,44	0,61%	0,56%
FR001400HCR4	CRED AGRICOLE SA 3.875% 23-20/04/2031	EUR	1 000 000	100,35	103,483	1 003 500	1 034 832,77	27 315,57	1 062 148,34	58 648,34	0,51%	0,47%
FR001400HO22	FRLBP 4% 05/28 EMTN	EUR	500 000	99,911	103,019	499 555	515 094,96	13 387,98	528 482,94	28 927,94	0,25%	0,23%
FR001400HX73	ORFP 3.125% 05/25 EMTN	EUR	600 000	99,796	99,901	598 776	599 408,28	11 731,56	611 139,84	12 363,84	0,29%	0,27%
FR001400II06	HOFP 3.625% 06/29 EMTN	EUR	500 000	99,187	102,327	495 935	511 636,65	10 052,94	521 689,59	25 754,59	0,25%	0,23%
FR001400IIU3	EDENFP 3.625% 06/31	EUR	100 000	99,251	101,918	99 251	101 917,81	2 020,49	103 938,3	4 687,3	0,05%	0,05%

# 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
Obligation						213 988 079,78	204 910 763,49		207 323 179,99	-6 664 899,79	100,00%	90,97%
Obligation Taux Fixe						192 451 536,78	183 471 981,61		185 574 809,65	-6 876 727,13	89,51%	81,43%
-						104 017 825,95	107 040 666,85		108 048 886,73	4 031 060,78	52,12%	47,41%
FR001400J188	OAT IE 0.6% 07/34 OATE	EUR	2 500 000	105,724	101,195	2 643 094,59	2 718 227,37	7 133,64	2 725 361,01	82 266,42	1,31%	1,20%
FR001400KJ00	MCFP 3.5% 09/33 EMTN	EUR	600 000	100	103,448	600 000	620 685,93	6 770,49	627 456,42	27 456,42	0,30%	0,28%
FR001400KJP7	MCFP 3.25% 09/29 EMTN	EUR	500 000	99,513	101,945	497 565	509 725,88	5 239,07	514 964,95	17 399,95	0,25%	0,23%
IT0005518128	BTPS 4.4% 05/33 10Y	EUR	22 000 000	100,13	106,571	22 028 600	23 445 672,36	167 538,46	23 613 210,82	1 584 610,82	11,39%	10,36%
IT0005549370	UCGIM 3.5% 07/30 EMTN	EUR	200 000	99,706	102,404	199 412	204 807,36	3 865,8	208 673,16	9 261,16	0,10%	0,09%
IT0005554578	ISPIM 3.625% 06/28	EUR	300 000	99,906	102,57	299 718	307 711,36	5 556,35	313 267,71	13 549,71	0,15%	0,14%
XS2575973776	NGGLN 3.875% 01/29 EMTN	EUR	500 000	100	102,873	500 000	514 367,49	18 684,93	533 052,42	33 052,42	0,26%	0,23%
XS2576067081	NGGLN 4.275% 01/35 EMTN	EUR	1 100 000	100	103,653	1 100 000	1 140 180,77	45 350,14	1 185 530,91	85 530,91	0,57%	0,52%
XS2595418323	BASGR 4% 03/29 EMTN	EUR	500 000	99,744	104,577	498 720	522 885,75	16 448,09	539 333,84	40 613,84	0,26%	0,24%
XS2598649254	NEST OY 3.875 03-29	EUR	400 000	99,606	103,232	398 424	412 928,4	12 408,47	425 336,87	26 912,87	0,21%	0,19%
XS2598746290	AALLN 4.5% 09/28 EMTN	EUR	900 000	99,406	104,006	894 654	936 050,13	12 172,13	948 222,26	53 568,26	0,46%	0,42%
XS2598746373	AALLN 5% 03/31 EMTN	EUR	400 000	99,587	106,695	398 348	426 779,48	16 065,57	442 845,05	44 497,05	0,21%	0,19%
XS2634593938	LIN 3.375% 06/29	EUR	500 000	99,642	102,843	498 210	514 217,12	9 451,84	523 668,96	25 458,96	0,25%	0,23%
XS2634826031	SANTAN 4.25% 06/30 EMTN	EUR	400 000	99,893	104,615	399 572	418 461,3	9 521,86	427 983,16	28 411,16	0,21%	0,19%
XS2644423035	DHLGR 3.375% 07/33 EMTN	EUR	347 000	99,824	102,268	346 389,28	354 868,7	5 887,62	360 756,32	14 367,04	0,17%	0,16%
XS2644756608	RY 4.125% 07/28	EUR	600 000	99,615	103,278	597 690	619 668,36	12 307,38	631 975,74	34 285,74	0,30%	0,28%
XS2648498371	IBESM 3.625% 07/33 EMTN	EUR	1 000 000	100,101	103,816	1 001 010	1 038 161,47	17 233,61	1 055 395,08	54 385,08	0,51%	0,46%
FONDS D'ETAT						82 570 820,83	70 845 262,03		71 913 994,54	-10 656 826,29	34,69%	31,55%
AT0000383864	AUSTRIA 6.25% 07/27	EUR	1 000 000	147,042	113,273	1 470 425	1 132 728,6	29 371,58	1 162 100,18	-308 324,82	0,56%	0,51%
BE0000291972	BELGIUM 5.50% 03/28	EUR	1 000 000	145,034	113,104	1 450 340	1 131 044,65	42 226,78	1 173 271,43	-277 068,57	0,57%	0,51%
DE0001135085	DBR 4.75% 04/07/28	EUR	10 500 000	113,916	111,992	11 961 133,34	11 759 168,93	249 375	12 008 543,93	47 410,59	5,79%	5,27%
ES0000012A89	SPAIN 1.45% 10/27	EUR	6 000 000	110,213	96,15	6 612 772,5	5 769 010,62	15 213,11	5 784 223,73	-828 548,77	2,79%	2,54%
ES0000012B88	SPAIN 1.4% 07/28	EUR	11 000 000	110,356	95,176	12 139 120,71	10 469 330,52	66 060,11	10 535 390,63	-1 603 730,08	5,08%	4,62%
FR0013510724	BPIFRA 0.125% 02/27	EUR	2 100 000	99,197	92,572	2 083 137	1 944 015,64	2 236,64	1 946 252,28	-136 884,72	0,94%	0,85%
IE00BKFCV568	IRELAND 0.2% 05/27	EUR	1 750 000	102,309	93,709	1 790 415	1 639 910,35	2 228,14	1 642 138,49	-148 276,51	0,79%	0,72%
IT0001174611	BTPS 6.50% 11/27	EUR	9 700 000	139,463	113,12	13 527 921,78	10 972 669,49	109 125	11 081 794,49	-2 446 127,29	5,35%	4,86%
IT0004889033	BTPS 4.75% 09/28	EUR	11 000 000	132,556	107,705	14 581 181,5	11 847 593,56	177 994,51	12 025 588,07	-2 555 593,43	5,80%	5,28%
NL0015031501	NEDERLD % 01/27	EUR	900 000	103,049	93,687	927 444	843 179,68	0	843 179,68	-84 264,32	0,41%	0,37%
PTOTEUOE0019	PORTUGAL 4.125% 04/27	EUR	12 600 000	127,198	105,846	16 026 930	13 336 609,99	374 901,64	13 711 511,63	-2 315 418,37	6,61%	6,02%
OBLIGATIONS DES COLLECTIVITES REGIONALES						4 083 540	3 740 475,96		3 754 666,01	-328 873,99	1,81%	1,65%
ES0000101966	MADRID 0.827% 07/27	EUR	4 000 000	102,088	93,512	4 083 540	3 740 475,96	14 190,05	3 754 666,01	-328 873,99	1,81%	1,65%
SECTEUR PRIVE CORPORATE DETTE SENIOR						859 350	901 853,93		904 533,38	45 183,38	0,44%	0,40%
XS2115091717	IBM 0.3% 02/28	EUR	1 000 000	85,935	90,185	859 350	901 853,93	2 679,45	904 533,38	45 183,38	0,44%	0,40%
SECTEUR PRIVE FINANCIER DETTE SENIOR						920 000	943 722,84		952 728,99	32 728,99	0,46%	0,42%
XS1200679071	BRK 1.125% 03/27	EUR	1 000 000	92	94,372	920 000	943 722,84	9 006,15	952 728,99	32 728,99	0,46%	0,42%

# 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
Obligation						213 988 079,78	204 910 763,49		207 323 179,99	-6 664 899,79	100,00%	90,97%
Obligation Taux Variable						21 536 543	21 438 781,88		21 748 370,34	211 827,34	10,49%	9,54%
-						20 540 413	20 472 898,44		20 781 159,03	240 746,03	10,02%	9,12%
FR001400DCZ6	BNP VAR 01/29 EMTN	EUR	1 000 000	99,881	103,642	998 810	1 036 416,77	42 551,37	1 078 968,14	80 158,14	0,52%	0,47%
FR001400F620	CNPFP VAR 07/53 EMTN	EUR	2 000 000	99,946	103,695	1 998 920	2 073 902,28	48 483,61	2 122 385,89	123 465,89	1,02%	0,93%
FR001400GDG7	ACAFP FRN 03/25 EMTN	EUR	2 000 000	100	100,187	2 000 000	2 003 734,52	6 417	2 010 151,52	10 151,52	0,97%	0,88%
PTEDP4OM0025	EDPPL VAR 04/83 EMTN	EUR	500 000	100	103,95	500 000	519 750,02	20 703,07	540 453,09	40 453,09	0,26%	0,24%
PTEDPLOM0017	EDPPL VAR 07/80	EUR	2 200 000	92,25	95,846	2 029 500	2 108 614,75	17 065,03	2 125 679,78	96 179,78	1,03%	0,93%
XS1061711575	AEGON VAR 4/44	EUR	1 000 000	102,25	99,546	1 022 500	995 463,66	27 650,27	1 023 113,93	613,93	0,49%	0,45%
XS1155697243	LAMON VAR PERP(5.05%)	EUR	2 000 000	105,6	100,276	2 112 000	2 005 512,34	4 691,26	2 010 203,6	-101 796,4	0,97%	0,88%
XS1591694481	TENN FRN PERP	EUR	1 000 000	100,49	99,69	1 004 900	996 897,16	17 675,41	1 014 572,57	9 672,57	0,49%	0,45%
XS2225204010	VOD VAR 08/80	EUR	400 000	81,24	89,669	324 960	358 676,95	4 229,51	362 906,46	37 946,46	0,18%	0,16%
XS2242931603	ENIIM VAR PERP NC9	EUR	1 500 000	83,85	91,939	1 257 750	1 379 087,82	11 342,21	1 390 430,03	132 680,03	0,67%	0,61%
XS2343563214	SWEDA VAR 05/27	EUR	5 000 000	100,43	92,441	5 021 500	4 622 070,55	9 344,26	4 631 414,81	-390 085,19	2,23%	2,03%
XS2582389156	TELEFO VAR PERP	EUR	1 000 000	97,125	103,172	971 250	1 031 724,6	56 195,02	1 087 919,62	116 669,62	0,52%	0,48%
XS2597696124	DNBNO VAR 03/29 EMTN	EUR	1 300 000	99,871	103,157	1 298 323	1 341 047,02	41 912,57	1 382 959,59	84 636,59	0,67%	0,61%
OBLIGATIONS INDEXEES ET PARTICIPANTES						996 130	965 883,44		967 211,31	-28 918,69	0,47%	0,42%
FR0013299468	CRLOG VAR 11/29	EUR	1 000 000	99,613	96,588	996 130	965 883,44	1 327,87	967 211,31	-28 918,69	0,47%	0,42%
<b>Total</b>						<b>233 970 733,84</b>	<b>225 492 222,11</b>		<b>2 412 416,5</b>	<b>-6 066 095,23</b>		