



# SIENNA OBLIGATIONS IMPACT SOCIAL 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	-43 896,75		-43 896,75	-43 896,75	100,00%	-0,08%
Future sur obligation						0	-43 896,75		-43 896,75	-43 896,75	100,00%	-0,08%
-						0	-43 896,75		-43 896,75	-43 896,75	100,00%	-0,08%
FBOL0000011J	EURO BUND 0324	EUR	-16	135,284	137,22	0	-30 980	0	-30 980	-30 980	70,57%	-0,06%
FBOL0000011M	EURO BTP 0324	EUR	-14	117,522	119,15	0	-22 791,75	0	-22 791,75	-22 791,75	51,92%	-0,04%
FBOL00000122	EURO SCHATZ 0324	EUR	25	106,15	106,545	0	9 875	0	9 875	9 875	-22,50%	0,02%
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	2 164 540				0		0	0	0,00%	0,00%
OFSFBOL0000011M	EURO BTP 0324 OFFSET	EUR	1 645 308,25				0		0	0	0,00%	0,00%
OFSFBOL00000122	EURO SCHATZ 0324 OFFSET	EUR	-2 653 750				0		0	0	0,00%	0,00%
Monétaire & Liquidité						5 422 529,95	5 587 136,94		5 587 136,94	164 606,99	100,00%	10,10%
Devise						365 206,73	484 289,2		484 289,2	119 082,47	8,67%	0,88%
-						365 206,73	484 289,2		484 289,2	119 082,47	8,67%	0,88%
CASH_EUR	Euro	EUR	484 289,2	1	1	365 206,73	484 289,2	0	484 289,2	119 082,47	8,67%	0,88%
Monétaire						2 498 362,18	2 498 976,36		2 498 976,36	614,18	44,73%	4,52%
-						2 498 362,18	2 498 976,36		2 498 976,36	614,18	44,73%	4,52%
FR0128070952	BTF 04/01/24	EUR	2 500 000	99,934	3,272	2 498 362,18	2 498 976,36	0	2 498 976,36	614,18	44,73%	4,52%
OPCVM Monétaire						2 558 961,04	2 603 871,38		2 603 871,38	44 910,34	46,60%	4,71%
OPCVM COURT TERME						2 558 961,04	2 603 871,38		2 603 871,38	44 910,34	46,60%	4,71%
FR0007081278	SIENNA MONETAIRE ISR A	EUR	21 499	119,027	121,116	2 558 961,04	2 603 871,38	0	2 603 871,38	44 910,34	46,60%	4,71%
Obligation						47 491 875,14	49 226 082,71		49 782 085,18	2 290 210,04	100,00%	89,98%
OPCVM Obligataire						2 064 159,56	2 177 320		2 177 320	113 160,44	4,37%	3,94%
-						2 064 159,56	2 177 320		2 177 320	113 160,44	4,37%	3,94%
FR001400GND3	SIENNA FDS IMPACT SOCIAL FFS	EUR	4 000	516,04	544,33	2 064 159,56	2 177 320	0	2 177 320	113 160,44	4,37%	3,94%
Obligation Taux Fixe						36 837 555,1	38 126 813,14		38 554 047,22	1 716 492,12	77,45%	69,69%
-						34 459 530,1	35 650 703,57		36 062 259,44	1 602 729,34	72,44%	65,18%
AT0000A2JAF6	ERSTBK 0.05% 09/25 EMTN	EUR	100 000	92,275	94,585	92 275	94 584,81	14,21	94 599,02	2 324,02	0,19%	0,17%
BE0002595735	GBLBBB 1.875% 06/25	EUR	100 000	97,011	97,833	97 011	97 833,01	988,73	98 821,74	1 810,74	0,20%	0,18%
BE0002767482	GBLBBB 0.125% 01/31	EUR	100 000	76,946	80,734	76 946	80 733,77	114,73	80 848,5	3 902,5	0,16%	0,15%
BE0002938190	GBLBBB 4% 05/33	EUR	200 000	99,66	105,267	199 320	210 533,56	4 983,61	215 517,17	16 197,17	0,43%	0,39%
CH0336602930	UBS 1.25% 01/09/26	EUR	200 000	90,376	95,131	180 752	190 262,42	812,84	191 075,26	10 323,26	0,38%	0,35%
DE000A2R8ND3	ANNGR 0.625% 10/27 EMTN	EUR	200 000	83,514	89,562	167 028	179 123,31	283,47	179 406,78	12 378,78	0,36%	0,32%
DE000A2YPFU9	MBGGR 1.125% 11/31 EMTN	EUR	128 000	84,388	87,631	108 016,64	112 168,3	208,52	112 376,82	4 360,18	0,23%	0,20%
DE000A351ZR8	DBOERS 3.875% 09/26	EUR	100 000	99,839	102,219	99 839	102 218,87	974,04	103 192,91	3 353,91	0,21%	0,19%
DE000A3E5MG8	ANNGR 0.375% 06/27 EMTN	EUR	200 000	82,869	89,505	165 738	179 009,02	401,64	179 410,66	13 672,66	0,36%	0,32%
DE000A3E5MH6	ANNGR 0.625% 12/29 EMTN	EUR	200 000	75,104	82,586	150 208	165 172,55	51,23	165 223,78	15 015,78	0,33%	0,30%
DE000A3LBMV2	MBGGR 3% 02/27 EMTN	EUR	100 000	97,33	100,205	97 330	100 204,73	2 539,73	102 744,46	5 414,46	0,21%	0,19%

# 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						47 491 875,14	49 226 082,71		49 782 085,18	2 290 210,04	100,00%	89,98%
Obligation Taux Fixe						36 837 555,1	38 126 813,14		38 554 047,22	1 716 492,12	77,45%	69,69%
-						34 459 530,1	35 650 703,57		36 062 259,44	1 602 729,34	72,44%	65,18%
DE000A3LH6T7	MBGGR 3.5% 05/26 EMTN	EUR	200 000	100,5	101,129	201 000	202 257,77	4 073,77	206 331,54	5 331,54	0,41%	0,37%
DE000A3MP4U9	ANNGR 0.25% 09/28 EMTN	EUR	200 000	77,673	85,121	155 346	170 242,86	162,57	170 405,43	15 059,43	0,34%	0,31%
DE000CZ45V82	CMZB 0.375% 09/27 EMTN	EUR	198 000	87,048	91,574	172 354,45	181 317,16	241,41	181 558,57	9 204,12	0,36%	0,33%
DE000CZ45VC5	CMZB 0.5% 12/26 EMTN	EUR	220 000	89,283	93,219	196 422,6	205 081,16	75,14	205 156,3	8 733,7	0,41%	0,37%
FR0013064573	GFCFP 3% 06/26	EUR	500 000	98,77	98,657	493 850	493 286,49	8 647,54	501 934,03	8 084,03	1,01%	0,91%
FR0013121753	LIFP 1.875% 02/26	EUR	100 000	95,726	97,376	95 726	97 376,26	1 607,88	98 984,14	3 258,14	0,20%	0,18%
FR0013176310	VIVFP 1.875% 05/26	EUR	100 000	95,422	97,994	95 422	97 994,1	1 111,68	99 105,78	3 683,78	0,20%	0,18%
FR0013216926	BNFP 1.208% 11/28	EUR	200 000	90,854	93,339	181 708	186 677,66	369,66	187 047,32	5 339,32	0,38%	0,34%
FR0013236544	CMARK 3.5% 02/29	EUR	100 000	94,875	99,033	94 875	99 032,95	3 097,26	102 130,21	7 255,21	0,21%	0,18%
FR0013257623	MCFP 0.75% 05/24	EUR	61 000	97,75	98,859	59 627,5	60 304,2	271,25	60 575,45	947,95	0,12%	0,11%
FR0013286788	DGFP 1.125% 10/27	EUR	200 000	92,277	94,193	184 554	188 385,65	473,36	188 859,01	4 305,01	0,38%	0,34%
FR0013310455	DGFP 1.375% 01/30 EMTN	EUR	200 000	89,576	92,069	179 152	184 138,14	2 569,18	186 707,32	7 555,32	0,38%	0,34%
FR0013324357	SANFP 1.375% 03/30 12FX	EUR	200 000	88,32	92,481	176 640	184 961,24	2 126,37	187 087,61	10 447,61	0,38%	0,34%
FR0013357852	MICHELIN (CIE GALE DE 1.75% 03/09/30 EUR	EUR	100 000	93	93,572	93 000	93 571,55	559,43	94 130,98	1 130,98	0,19%	0,17%
FR0013404571	DGFP 1.375% 02/31 EMTN	EUR	500 000	87,36	90,012	436 800	450 060,29	5 857,88	455 918,17	19 118,17	0,92%	0,82%
FR0013425147	PUBFP 1.25% 06/28 EMTN	EUR	600 000	90,28	92,485	541 680	554 910,74	4 077,87	558 988,61	17 308,61	1,12%	1,01%
FR0013444544	DSYFP 0.125% 09/26	EUR	500 000	90,598	93,253	452 990	466 266,83	177,6	466 444,43	13 454,43	0,94%	0,84%
FR0013447232	COVFP 1.125% 09/31	EUR	200 000	77,764	82,534	155 528	165 067,52	633,2	165 700,72	10 172,72	0,33%	0,30%
FR0013448859	SOCGEN 0.875% 09/29 EMTN	EUR	100 000	81,598	85,67	81 598	85 669,98	229,51	85 899,49	4 301,49	0,17%	0,16%
FR0013476553	BFCM 0.75% 01/30	EUR	200 000	81,165	84,76	162 330	169 520,69	1 421,92	170 942,61	8 612,61	0,34%	0,31%
FR0013486701	SOCGEN 0.125% 02/26	EUR	300 000	90,787	93,716	272 361	281 148,42	316,44	281 464,86	9 103,86	0,57%	0,51%
FR0013494168	SUFP 0.25% 03/29 EMTN	EUR	400 000	86,164	88,356	344 656	353 424,11	800,55	354 224,66	9 568,66	0,71%	0,64%
FR0013512233	LIFP 2% 05/29 EMTN	EUR	100 000	87,247	93,938	87 247	93 938,08	1 262,3	95 200,38	7 953,38	0,19%	0,17%
FR0013513538	LRFP 0.75% 05/30	EUR	300 000	85,872	87,774	257 616	263 321,55	1 370,9	264 692,45	7 076,45	0,53%	0,48%
FR0013515749	BFCM 1.25% 06/30	EUR	200 000	83,574	86,604	167 148	173 208,17	1 427,6	174 635,77	7 487,77	0,35%	0,32%
FR0013518057	SOCGEN 1.25% 06/30	EUR	100 000	81,25	86,159	81 250	86 159,19	683,06	86 842,25	5 592,25	0,17%	0,16%
FR0013519279	COVFP 1.625% 06/30	EUR	100 000	83,162	88,859	83 162	88 858,82	839,14	89 697,96	6 535,96	0,18%	0,16%
FR0014000717	BFCM 0.625% 02/31 EMTN	EUR	300 000	77,87	82,011	233 610	246 033,71	1 597,6	247 631,31	14 021,31	0,50%	0,45%
FR0014000KT3	LIFP 0.875% 02/31 EMTN	EUR	200 000	76,341	83,363	152 682	166 725,44	1 510,27	168 235,71	15 553,71	0,34%	0,30%
FR0014001EW8	ALOPF % 01/29	EUR	300 000	82,694	82,606	248 082	247 819,44	0	247 819,44	-262,56	0,50%	0,45%
FR0014001G37	BPCEGP 0.25% 01/31	EUR	300 000	76,433	80,653	229 299	241 957,98	717,12	242 675,1	13 376,1	0,49%	0,44%
FR0014003N69	AIFP 0.375% 05/31 EMTN	EUR	900 000	83,09	84,615	747 810	761 534,27	1 991,8	763 526,07	15 716,07	1,53%	1,38%
FR0014003SAO	BFCM 0.625% 11/28 EMTN	EUR	100 000	83,282	87,589	83 282	87 588,79	95,63	87 684,42	4 402,42	0,18%	0,16%
FR00140049A8	GFCFP 0.875% 06/36 EMTN	EUR	200 000	67,4	74,142	134 800	148 283,35	870,22	149 153,57	14 353,57	0,30%	0,27%
FR0014005OK3	LRFP 0.375% 10/31	EUR	100 000	79,6	83,758	79 600	83 758,19	86,07	83 844,26	4 244,26	0,17%	0,15%

# 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						47 491 875,14	49 226 082,71		49 782 085,18	2 290 210,04	100,00%	89,98%
Obligation Taux Fixe						36 837 555,1	38 126 813,14		38 554 047,22	1 716 492,12	77,45%	69,69%
-						34 459 530,1	35 650 703,57		36 062 259,44	1 602 729,34	72,44%	65,18%
FR0014006ZC4	ORAFP 0.625% 12/33 EMTN	EUR	200 000	75,65	80,251	151 300	160 502,29	44,4	160 546,69	9 246,69	0,32%	0,29%
FR0014009KQ0	SANFP 1.25% 04/29	EUR	100 000	91,155	93,186	91 155	93 185,89	911,89	94 097,78	2 942,78	0,19%	0,17%
FR0014009YD9	BPCEGP 1.75% 04/27 EMTN	EUR	200 000	93,29	95,79	186 580	191 580,04	2 362,02	193 942,06	7 362,06	0,39%	0,35%
FR001400A5N5	KERFP 1.25% 05/25 EMTN	EUR	100 000	96,546	97,27	96 546	97 270,16	812,84	98 083	1 537	0,20%	0,18%
FR001400AO14	SOCGEN 2.625% 05/29 EMTN	EUR	200 000	94,846	97,354	189 692	194 708,39	3 055,33	197 763,72	8 071,72	0,40%	0,36%
FR001400ASKO	RCFFP 3.75% 06/29 EMTN	EUR	200 000	97,978	99,818	195 956	199 636,31	3 852,46	203 488,77	7 532,77	0,41%	0,37%
FR001400B1L7	RENAUL 4.75% 07/27 EMTN	EUR	100 000	99,929	104,545	99 929	104 545,31	2 284,15	106 829,46	6 900,46	0,21%	0,19%
FR001400CMYO	BFCM 3.125% 09/27 EMTN	EUR	100 000	98,17	99,745	98 170	99 745,29	905,05	100 650,34	2 480,34	0,20%	0,18%
FR001400CQ85	CMARK 3.375% 09/27 EMTN	EUR	200 000	98,316	100,483	196 632	200 965,67	1 862,7	202 828,37	6 196,37	0,41%	0,37%
FR001400DOV0	RIFP 3.25% 11/28 EMTN	EUR	100 000	100,571	101,646	100 571	101 646,05	506,15	102 152,2	1 581,2	0,21%	0,18%
FR001400E904	RENAUL 4.125% 12/25 EMTN	EUR	176 000	100,568	100,768	176 999,68	177 351,64	555,41	177 907,05	907,37	0,36%	0,32%
FR001400EAY1	BFCM 3.75% 02/33 EMTN	EUR	100 000	100,14	102,244	100 140	102 243,92	3 400,68	105 644,6	5 504,6	0,21%	0,19%
FR001400F19	ENGIFP 4% 01/35 EMTN	EUR	300 000	99,76	104,11	299 280	312 331,3	11 572,6	323 903,9	24 623,9	0,65%	0,59%
FR001400F6E7	ALDFP 4.25% 01/27 EMTN	EUR	200 000	100,245	102,338	200 490	204 676,85	8 034,25	212 711,1	12 221,1	0,43%	0,38%
FR001400HOZ2	FRLBP 4% 05/28 EMTN	EUR	400 000	99,911	103,019	399 644	412 075,98	10 491,8	422 567,78	22 923,78	0,85%	0,76%
FR001400HQM5	CAFP 4.079% 05/27 EMTN	EUR	400 000	100	101,66	400 000	406 641,72	10 609,86	417 251,58	17 251,58	0,84%	0,75%
FR001400HU68	CAFP 3.75% 10/30 EMTN	EUR	500 000	99,654	102,187	498 270	510 933,26	4 098,36	515 031,62	16 761,62	1,03%	0,93%
FR001400I186	CMARK 3.875% 05/28 EMTN	EUR	200 000	99,862	102,292	199 724	204 583,95	4 679,64	209 263,59	9 539,59	0,42%	0,38%
FR001400I3C5	BNFP 3.47% 05/31 EMTN	EUR	200 000	100	102,826	200 000	205 651,87	4 190,55	209 842,42	9 842,42	0,42%	0,38%
FR001400I4X9	BNP 4.125% 05/33 EMTN	EUR	100 000	99,871	105,56	99 871	105 560,17	2 468,24	108 028,41	8 157,41	0,22%	0,20%
FR001400I5S6	LRFP 3.5% 05/29	EUR	200 000	98,53	103,44	197 060	206 879,98	4 092,9	210 972,88	13 912,88	0,42%	0,38%
FR001400II06	HOPF 3.625% 06/29 EMTN	EUR	100 000	99,187	102,327	99 187	102 327,33	1 961,07	104 288,4	5 101,4	0,21%	0,19%
FR001400KHF2	ENGIFP 3.75 C '27 EUR	EUR	100 000	99,563	102,109	99 563	102 108,64	1 168,03	103 276,67	3 713,67	0,21%	0,19%
FR001400KH16	ENGIFP 4.5 C '42 EUR	EUR	100 000	98,751	107,954	98 751	107 953,87	1 401,64	109 355,51	10 604,51	0,22%	0,20%
FR001400KHW7	KERFP 3.625% 09/31 EMTN	EUR	100 000	99,211	103,549	99 211	103 548,51	1 139	104 687,51	5 476,51	0,21%	0,19%
FR001400KHX5	KERFP 3.875% 09/35 EMTN	EUR	100 000	99,294	105,048	99 294	105 047,74	1 217,55	106 265,29	6 971,29	0,21%	0,19%
FR001400KJ00	MCFP 3.5% 09/33 EMTN	EUR	100 000	100	103,448	100 000	103 447,66	1 080,6	104 528,26	4 528,26	0,21%	0,19%
FR001400KJP7	MCFP 3.25% 09/29 EMTN	EUR	100 000	99,513	101,945	99 513	101 945,17	1 003,42	102 948,59	3 435,59	0,21%	0,19%
FR001400KKM2	ORAFP 3.875% 09/35 EMTN	EUR	100 000	95,457	106,577	95 457	106 576,72	1 154,03	107 730,75	12 273,75	0,22%	0,19%
FR001400KL23	PRAEFP 5.5% 09/28	EUR	100 000	99,885	104,821	99 885	104 821,24	1 517,76	106 339	6 454	0,21%	0,19%
FR001400KY69	RENAUL 4.875% 10/29 EMTN	EUR	100 000	100,404	105,298	100 404	105 297,58	1 172,13	106 469,71	6 065,71	0,21%	0,19%
FR001400KZP3	SOCGEN 4.25% 09/26	EUR	200 000	99,876	102,545	199 752	205 090,1	2 136,61	207 226,71	7 474,71	0,42%	0,37%
FR001400L255	HOPF 4.125% 10/28 EMTN	EUR	100 000	99,606	104,563	99 606	104 562,77	811,48	105 374,25	5 768,25	0,21%	0,19%
FR001400LWN3	BFCM 4.75% 11/31 EMTN	EUR	100 000	99,564	106,239	99 564	106 238,94	635,93	106 874,87	7 310,87	0,21%	0,19%
FR001400M6G3	SOCGEN 4.125% 11/28 EMTN	EUR	100 000	99,854	103,64	99 854	103 639,5	428,28	104 067,78	4 213,78	0,21%	0,19%

# 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						47 491 875,14	49 226 082,71		49 782 085,18	2 290 210,04	100,00%	89,98%
Obligation Taux Fixe						36 837 555,1	38 126 813,14		38 554 047,22	1 716 492,12	77,45%	69,69%
-						34 459 530,1	35 650 703,57		36 062 259,44	1 602 729,34	72,44%	65,18%
FR001400M9L7	EDF 3.75% 06/27 EMTN	EUR	100 000	99,776	102,025	99 776	102 024,51	245,9	102 270,41	2 494,41	0,21%	0,18%
FR001400MDV4	COVFP 4.625% 06/32 EMTN	EUR	100 000	99,661	103,793	99 661	103 793,43	303,28	104 096,71	4 435,71	0,21%	0,19%
PTEDPUOM0008	EDPPL 3.875% 06/28 EMTN	EUR	100 000	99,884	102,88	99 884	102 880,19	1 969,26	104 849,45	4 965,45	0,21%	0,19%
XS0525602339	RABOBK 4.125% 07/25	EUR	300 000	100,9	101,173	302 700	303 519,09	5 680,33	309 199,42	6 499,42	0,62%	0,56%
XS1231027464	REEDLN 1.3% 05/25	EUR	300 000	96,252	97,197	288 756	291 590,66	2 461,48	294 052,14	5 296,14	0,59%	0,53%
XS1617831026	BFCM 1.25% 05/27	EUR	100 000	91,225	93,875	91 225	93 875,43	741,12	94 616,55	3 391,55	0,19%	0,17%
XS1681520356	GSK 1.375% 09/29	EUR	100 000	90,703	92,8	90 703	92 799,88	405,74	93 205,62	2 502,62	0,19%	0,17%
XS1822828122	GSK 1.25% 05/26 EMTN	EUR	400 000	94,77	96,316	379 080	385 263,1	3 032,79	388 295,89	9 215,89	0,78%	0,70%
XS1822829799	GSK 1.75% 05/30 EMTN	EUR	100 000	91,435	93,864	91 435	93 863,56	1 061,48	94 925,04	3 490,04	0,19%	0,17%
XS1856281834	TTEFP 1.619% 07/33 EMTN	EUR	200 000	82	85,131	164 000	170 261,52	1 512,84	171 774,36	7 774,36	0,35%	0,31%
XS1917358621	DHLGR 1.625% 12/28 EMTN	EUR	200 000	93,775	95,405	187 550	190 810,17	213,11	191 023,28	3 473,28	0,38%	0,35%
XS1953240261	TELIAS 2.125% 02/34 EMTN	EUR	200 000	85,937	90,455	171 874	180 910,99	3 632,88	184 543,87	12 669,87	0,37%	0,33%
XS1953778807	ACHMEA 0.5% 02/26 EMTN	EUR	100 000	92,829	94,94	92 829,2	94 939,73	427,4	95 367,13	2 537,93	0,19%	0,17%
XS1996441066	RTOLN 0.875% 05/26 EMTN	EUR	400 000	92,96	94,704	371 840	378 814,1	2 036,89	380 850,99	9 010,99	0,77%	0,69%
XS2023644540	MRKGR 0.875% 07/31 EMTN	EUR	400 000	84,35	86,284	337 400	345 136,7	1 692,62	346 829,32	9 429,32	0,70%	0,63%
XS2025468542	CM 0.04% 07/27 EMTN	EUR	100 000	87,663	90,513	87 663	90 513,1	18,91	90 532,01	2 869,01	0,18%	0,16%
XS2028816028	SABSM 0.875% 07/25 EMTN	EUR	200 000	93,16	96,285	186 320	192 569,69	765,03	193 334,72	7 014,72	0,39%	0,35%
XS2032727310	IGIM 0.875% 04/30 EMTN	EUR	100 000	82,898	86,235	82 898	86 235,47	595,29	86 830,76	3 932,76	0,17%	0,16%
XS2049803575	VMUKLN 0.01% 09/26 EMTN	EUR	300 000	88,786	92,059	266 358	276 178,03	8,03	276 186,06	9 828,06	0,55%	0,50%
XS2051777873	SMDSLN 0.875% 09/26 EMTN	EUR	300 000	90,895	93,378	272 685	280 135,27	774,59	280 909,86	8 224,86	0,56%	0,51%
XS2054600718	LLOYDS 0.125% 09/29 EMTN	EUR	200 000	82,208	85,89	164 416	171 780,95	66,26	171 847,21	7 431,21	0,35%	0,31%
XS2063268754	IDSLN 1.25% 10/26	EUR	200 000	91,33	93,53	182 660	187 059,47	560,11	187 619,58	4 959,58	0,38%	0,34%
XS2084497705	FMEGR 0.625% 11/26 EMTN	EUR	100 000	91,529	91,683	91 529	91 682,88	49,52	91 732,4	203,4	0,18%	0,17%
XS2126161764	RELLN 0.5% 03/28	EUR	300 000	88,143	90,817	264 429	272 451,95	1 204,92	273 656,87	9 227,87	0,55%	0,49%
XS2126162069	RELLN 0.875% 03/32	EUR	200 000	82,45	84,547	164 900	169 093,19	1 405,74	170 498,93	5 598,93	0,34%	0,31%
XS2151069775	LLOYDS 2.375% 04/26 EMTN	EUR	100 000	96,954	98,265	96 954	98 265,01	1 713,11	99 978,12	3 024,12	0,20%	0,18%
XS2168478068	CRHID 1.25% 11/26 EMTN	EUR	200 000	93,228	95,356	186 456	190 712,04	368,85	191 080,89	4 624,89	0,38%	0,35%
XS2179037697	ISPIM 2.125% 05/25 EMTN	EUR	100 000	96,721	98,047	96 721	98 046,84	1 259,9	99 306,74	2 585,74	0,20%	0,18%
XS2190256706	SRGIM 0.75% 06/30 EMTN	EUR	100 000	81,191	85,067	81 191	85 066,81	399,59	85 466,4	4 275,4	0,17%	0,15%
XS2199343513	ISSDC 1.25% 07/25 EMTN	EUR	100 000	94,97	96,274	94 970	96 274,28	597,68	96 871,96	1 901,96	0,19%	0,18%
XS2200513070	NGGLN 0.823% 07/32 EMTN	EUR	300 000	78,252	81,297	234 756	243 889,58	1 180,53	245 070,11	10 314,11	0,49%	0,44%
XS2207657417	NWIDE 0.25% 07/25	EUR	200 000	92,988	95,221	185 976	190 442,61	218,58	190 661,19	4 685,19	0,38%	0,34%
XS2237901355	TRNIM 0.375% 09/30 EMTN	EUR	100 000	78,9	82,943	78 900	82 943,3	97,34	83 040,64	4 140,64	0,17%	0,15%
XS2265360359	STERV 0.625% 12/30 EMTN	EUR	200 000	80,228	81,592	160 456	163 183,88	92,21	163 276,09	2 820,09	0,33%	0,30%
XS2265968284	SHBASS 0.01% 12/27 EMTN	EUR	100 000	84,587	88,565	84 587	88 565,44	0,74	88 566,18	3 979,18	0,18%	0,16%

# 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						47 491 875,14	49 226 082,71		49 782 085,18	2 290 210,04	100,00%	89,98%
Obligation Taux Fixe						36 837 555,1	38 126 813,14		38 554 047,22	1 716 492,12	77,45%	69,69%
-						34 459 530,1	35 650 703,57		36 062 259,44	1 602 729,34	72,44%	65,18%
XS2268340010	SRGIM % 12/28 EMTN	EUR	100 000	81,932	85,896	81 932	85 895,91	0	85 895,91	3 963,91	0,17%	0,16%
XS2282210231	SWEDA 0.2% 01/28 GMTN	EUR	200 000	83,824	87,281	167 648	174 561,63	384,66	174 946,29	7 298,29	0,35%	0,32%
XS2299001888	IGIM % 02/28 EMTN	EUR	200 000	85,498	88,603	170 996	177 205,88	0	177 205,88	6 209,88	0,36%	0,32%
XS2300208928	SRGIM % 08/25 EMTN	EUR	100 000	92,66	94,914	92 660	94 913,82	0	94 913,82	2 253,82	0,19%	0,17%
XS2304664167	ISPIM 0.625% 02/26 EMTN	EUR	250 000	91,329	94,07	228 322,5	235 175,55	1 318,49	236 494,04	8 171,54	0,48%	0,43%
XS2317069685	ISPIM 0.75% 03/28 EMTN	EUR	100 000	86,317	90,152	86 317	90 151,76	590,16	90 741,92	4 424,92	0,18%	0,16%
XS2337061670	CCEP 0.5% 09/29	EUR	200 000	83,401	86,77	166 802	173 539,73	311,48	173 851,21	7 049,21	0,35%	0,31%
XS2343114687	ERFFP 0.875% 05/31	EUR	500 000	77,321	81,451	386 605	407 256,33	2 677,6	409 933,93	23 328,93	0,82%	0,74%
XS2345317510	SHBASS 0.05% 09/28 EMTN	EUR	100 000	83,063	87,095	83 063	87 094,65	15,57	87 110,22	4 047,22	0,17%	0,16%
XS2356049069	SEB 0.375% 06/28 GMTN	EUR	400 000	82,5	87,513	330 000	350 050,7	782,79	350 833,49	20 833,49	0,70%	0,63%
XS2357205587	TRNIM 0.375% 06/29 EMTN	EUR	100 000	83,556	86,513	83 556	86 512,74	193,65	86 706,39	3 150,39	0,17%	0,16%
XS2374594823	VW 0.375% 02/30 EMTN	EUR	171 000	78,693	82,783	134 565,03	141 558,98	562,19	142 121,17	7 556,14	0,29%	0,26%
XS2374595044	VW 0.125% 02/27 EMTN	EUR	176 000	87,62	90,897	154 211,2	159 979,36	192,88	160 172,24	5 961,04	0,32%	0,29%
XS2390400716	ENELIM 0.375% 05/29 EMTN	EUR	300 000	82,723	86,225	248 169	258 675,19	660,86	259 336,05	11 167,05	0,52%	0,47%
XS2390837495	NACN 0.01% 09/26	EUR	200 000	89,567	92,551	179 134	185 102,39	4,97	185 107,36	5 973,36	0,37%	0,33%
XS2404629235	SHBASS 0.125% 11/26 EMTN	EUR	100 000	89,298	91,978	89 298	91 978,07	19,13	91 997,2	2 699,2	0,18%	0,17%
XS2406890066	KPN 0.875% 11/33 GMTN	EUR	100 000	76,347	79,936	76 347	79 935,64	105,19	80 040,83	3 693,83	0,16%	0,14%
XS2443893255	NDAFH 1.125% 02/27 EMTN	EUR	200 000	91,03	94,01	182 060	188 020,92	1 947,95	189 968,87	7 908,87	0,38%	0,34%
XS2454011839	CM 0.375% 03/26 EMTN	EUR	100 000	92,096	94,449	92 096,4	94 448,82	301,23	94 750,05	2 653,65	0,19%	0,17%
XS2455983861	IBESM 1.375% 03/32 EMTN	EUR	200 000	83,34	88,83	166 680	177 659,67	2 201,5	179 861,17	13 181,17	0,36%	0,33%
XS2461785185	CASTSS 2% 03/25 EMTN	EUR	100 000	91,292	96,617	91 292	96 616,51	1 530,05	98 146,56	6 854,56	0,20%	0,18%
XS2466368938	DGELN 1.5% 06/29 EMTN	EUR	100 000	91,271	93,234	91 271	93 234,32	836,07	94 070,39	2 799,39	0,19%	0,17%
XS2472603740	RY 2.125% 04/29 EMTN	EUR	300 000	90,597	94,361	271 791	283 081,58	4 302,25	287 383,83	15 592,83	0,58%	0,52%
XS2473346299	NWIDE 2% 04/27	EUR	200 000	93,61	96,25	187 220	192 499,32	2 677,6	195 176,92	7 956,92	0,39%	0,35%
XS2478299386	TENN 2.375% 05/33 EMTN	EUR	200 000	92,71	95,81	185 420	191 619,91	2 933,06	194 552,97	9 132,97	0,39%	0,35%
XS2485152362	SWEDA 2.1% 05/27 EMTN	EUR	100 000	94,41	96,343	94 410	96 343,39	1 250,82	97 594,21	3 184,21	0,20%	0,18%
XS2489775580	SESGFP 3.5% 01/29 EMTN	EUR	100 000	92,08	98,689	92 080	98 688,59	3 346,58	102 035,17	9 955,17	0,20%	0,18%
XS2491029380	MRKGR 2.375% 06/30 EMTN	EUR	100 000	96,138	96,947	96 138	96 946,83	1 278,35	98 225,18	2 087,18	0,20%	0,18%
XS2494945939	RTOLN 3.875% 06/27 EMTN	EUR	300 000	101,397	102,016	304 191	306 048,83	5 876,02	311 924,85	7 733,85	0,63%	0,56%
XS2530444624	FMEGR 3.875% 09/27 EMTN	EUR	100 000	99,73	101,914	99 730	101 913,72	1 058,74	102 972,46	3 242,46	0,21%	0,19%
XS2534276808	SRBANK 2.875% 09/25 EMTN	EUR	100 000	98,248	99,153	98 248	99 153,41	785,52	99 938,93	1 690,93	0,20%	0,18%
XS2534891978	KNOGR 3.25% 09/27 EMTN	EUR	100 000	98,065	100,944	98 065	100 943,99	879,1	101 823,09	3 758,09	0,20%	0,18%
XS2544624112	BMO 2.75% 10/26	EUR	100 000	97,961	99,54	97 961	99 540	578,55	100 118,55	2 157,55	0,20%	0,18%
XS2545759099	ISPIM 5.25% 01/30 EMTN	EUR	100 000	104,49	107,378	104 490	107 377,95	5 034,25	112 412,2	7 922,2	0,23%	0,20%
XS2558966953	IBESM 3.375% 11/32 EMTN	EUR	100 000	97,261	102,214	97 261	102 214,47	341,19	102 555,66	5 294,66	0,21%	0,19%

# 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						47 491 875,14	49 226 082,71		49 782 085,18	2 290 210,04	100,00%	89,98%
Obligation Taux Fixe						36 837 555,1	38 126 813,14		38 554 047,22	1 716 492,12	77,45%	69,69%
-						34 459 530,1	35 650 703,57		36 062 259,44	1 602 729,34	72,44%	65,18%
XS2560495116	VOD 3.75% 12/34 EMTN	EUR	100 000	99,853	103,368	99 852,5	103 368,35	276,64	103 644,99	3 792,49	0,21%	0,19%
XS2574873183	EOANGR 3.875% 01/35 EMTN	EUR	100 000	98,78	104,13	98 780	104 129,69	3 726,37	107 856,06	9 076,06	0,22%	0,19%
XS2575973776	NGGLN 3.875% 01/29 EMTN	EUR	100 000	100,888	102,873	100 888,5	102 873,5	3 683,9	106 557,4	5 668,9	0,21%	0,19%
XS2576067081	NGGLN 4.275% 01/35 EMTN	EUR	100 000	101,088	103,653	101 087,5	103 652,8	4 064,18	107 716,98	6 629,48	0,22%	0,19%
XS2582814039	BRITEL 3.75% 05/31 EMTN	EUR	350 000	98,862	102,886	346 017	360 099,62	8 247,95	368 347,57	22 330,57	0,74%	0,67%
XS2590621368	NBNAUS 4.375% 03/33 GMTN	EUR	100 000	100,786	107,431	100 786	107 430,96	3 454,58	110 885,54	10 099,54	0,22%	0,20%
XS2590758665	AT&T 3.95% 04/31	EUR	100 000	99,883	103,9	99 883	103 900,1	2 428,28	106 328,38	6 445,38	0,21%	0,19%
XS2597093009	TOYOTA 4.05% 09/29 EMTN	EUR	100 000	101,756	105,049	101 756	105 049,35	1 184,02	106 233,37	4 477,37	0,21%	0,19%
XS2597919013	NWIDE 3.625% 03/28	EUR	200 000	101,81	103,24	203 620	206 479,12	5 724,73	212 203,85	8 583,85	0,43%	0,38%
XS2598649254	NEST OY 3.875 03-29	EUR	100 000	102,371	103,232	102 371,5	103 232,1	3 049,18	106 281,28	3 909,78	0,21%	0,19%
XS2598746290	AALLN 4.5% 09/28 EMTN	EUR	100 000	103,266	104,006	103 266	104 005,57	1 290,98	105 296,55	2 030,55	0,21%	0,19%
XS2598746373	AALLN 5% 03/31 EMTN	EUR	100 000	103,923	106,695	103 923	106 694,87	3 948,09	110 642,96	6 719,96	0,22%	0,20%
XS2604697891	VW 3.875% 03/26 EMTN	EUR	300 000	100,152	100,808	300 456	302 424,26	8 734,63	311 158,89	10 702,89	0,63%	0,56%
XS2607063497	CM 3.25% 03/27 EMTN	EUR	200 000	99,586	100,934	199 172,2	201 867,98	4 848,36	206 716,34	7 544,14	0,42%	0,37%
XS2607193435	TRNIM 3.625% 04/29 EMTN	EUR	800 000	99,281	102,212	794 248	817 698,88	19 967,21	837 666,09	43 418,09	1,68%	1,51%
XS2615559130	NACN 3.5% 04/28	EUR	300 000	99,914	102,451	299 742	307 351,53	7 114,75	314 466,28	14 724,28	0,63%	0,57%
XS2616008970	SIKASW 3.75% 05/30	EUR	125 000	99,451	103,056	124 313,75	128 819,49	3 073,77	131 893,26	7 579,51	0,26%	0,24%
XS2617442525	VW 4.25% 01/26 EMTN	EUR	100 000	99,944	101,246	99 944	101 246,02	2 794,52	104 040,54	4 096,54	0,21%	0,19%
XS2618499177	SHBASS 3.75% 05/26 EMTN	EUR	100 000	99,724	101,324	99 724	101 323,93	2 438,52	103 762,45	4 038,45	0,21%	0,19%
XS2618906585	NDAFH 4.125% 05/28 EMTN	EUR	200 000	99,703	103,357	199 406	206 714,77	5 364,75	212 079,52	12 673,52	0,43%	0,38%
XS2623956773	ENIIM 4.25% 05/33 EMTN	EUR	200 000	99,505	105,099	199 010	210 197,07	5 202,19	215 399,26	16 389,26	0,43%	0,39%
XS2623957078	ENIIM 3.625% 05/27 EMTN	EUR	200 000	99,982	101,623	199 964	203 246,9	4 437,16	207 684,06	7 720,06	0,42%	0,38%
XS2625195891	ISPIM 4% 05/26 EMTN	EUR	200 000	99,884	101,509	199 768	203 018,54	4 896,17	207 914,71	8 146,71	0,42%	0,38%
XS2625968347	BMW 3.25% 07/30 EMTN	EUR	100 000	99,329	102,376	99 329	102 375,65	1 420,77	103 796,42	4 467,42	0,21%	0,19%
XS2625968693	BMW 3.25% 11/26 EMTN	EUR	100 000	99,123	100,93	99 123	100 930,43	334,03	101 264,46	2 141,46	0,20%	0,18%
XS2625968776	BMW 3.625% 05/35 EMTN	EUR	100 000	99,923	104,228	99 923	104 228,09	2 188,87	106 416,96	6 493,96	0,21%	0,19%
XS2629064267	STERV 4.25% 09/29 EMTN	EUR	200 000	98,42	102,693	196 840	205 385,32	2 763,66	208 148,98	11 308,98	0,42%	0,38%
XS2632655135	UNANA 3.4% 06/33 EMTN	EUR	100 000	99,301	103,224	99 301	103 224,16	1 913,66	105 137,82	5 836,82	0,21%	0,19%
XS2633317701	IGIM 4.125% 06/32 EMTN	EUR	300 000	98,746	103,602	296 238	310 804,93	6 897,54	317 702,47	21 464,47	0,64%	0,57%
XS2634690114	STLA 4.25% 06/31 EMTN	EUR	100 000	99,059	103,894	99 059	103 893,53	2 275,96	106 169,49	7 110,49	0,21%	0,19%
XS2636745882	ATOSTR 5.125% 06/33 EMTN	EUR	100 000	99,617	104,907	99 617	104 906,52	2 772,54	107 679,06	8 062,06	0,22%	0,19%
XS2643041721	SEB 4.125% 06/27 EMTN	EUR	100 000	99,949	103,068	99 949	103 067,51	2 062,5	105 130,01	5 181,01	0,21%	0,19%
XS2644756608	RY 4.125% 07/28	EUR	100 000	99,615	103,278	99 615	103 278,06	1 994,88	105 272,94	5 657,94	0,21%	0,19%
XS2648498371	IBESM 3.625% 07/33 EMTN	EUR	400 000	100,101	103,816	400 404	415 264,58	6 695,36	421 959,94	21 555,94	0,85%	0,76%
XS2655852726	TRNIM 3.875% 07/33 EMTN	EUR	200 000	99,107	103,288	198 214	206 576,26	3 345,63	209 921,89	11 707,89	0,42%	0,38%

# 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						47 491 875,14	49 226 082,71		49 782 085,18	2 290 210,04	100,00%	89,98%
Obligation Taux Fixe						36 837 555,1	38 126 813,14		38 554 047,22	1 716 492,12	77,45%	69,69%
-						34 459 530,1	35 650 703,57		36 062 259,44	1 602 729,34	72,44%	65,18%
XS2671621402	VLVY 3.875% 08/26 EMTN	EUR	200 000	99,518	101,945	199 036	203 889,53	2 583,33	206 472,86	7 436,86	0,41%	0,37%
XS2673969650	IDSLN 5.25% 09/28	EUR	200 000	99,575	103,888	199 150	207 775,25	3 040,98	210 816,23	11 666,23	0,42%	0,38%
XS2675685700	SSELN 4% 09/31 EMTN	EUR	200 000	99,966	104,683	199 932	209 366,4	2 513,66	211 880,06	11 948,06	0,43%	0,38%
XS2676863355	PHIANA 4.25% 09/31 EMTN	EUR	100 000	99,741	102,558	99 741	102 558,37	1 300,55	103 858,92	4 117,92	0,21%	0,19%
XS2679903950	LSELN 4.125% 09/26 EMTN	EUR	100 000	100	102,624	100 000	102 624,14	1 025,61	103 649,75	3 649,75	0,21%	0,19%
XS2679904685	LSELN 4.231% 09/30 EMTN	EUR	100 000	100	105,67	100 000	105 669,52	1 051,97	106 721,49	6 721,49	0,21%	0,19%
XS2680745382	NGGLN 4.668% 09/33 EMTN	EUR	200 000	100	106,901	200 000	213 802,24	2 754,89	216 557,13	16 557,13	0,44%	0,39%
XS2680945479	FERR SE 4.375 09-30	EUR	126 000	99,587	105,591	125 479,62	133 044,45	1 611,58	134 656,03	9 176,41	0,27%	0,24%
XS2681384041	RKTLN 3.875% 09/33 EMTN	EUR	100 000	99,658	105,997	99 658	105 997,2	1 122,27	107 119,47	7 461,47	0,22%	0,19%
XS2696780464	RY 4.375% 10/30 EMTN	EUR	200 000	99,563	105,257	199 126	210 513	2 103,83	212 616,83	13 490,83	0,43%	0,38%
XS2698773913	BMW 4.125% 10/33 EMTN	EUR	119 000	99,007	107,875	117 818,33	128 371,39	1 153,42	129 524,81	11 706,48	0,26%	0,23%
XS2699159351	EDPPL 4.375% 04/32 EMTN	EUR	100 000	99,06	106,698	99 060	106 698,42	1 028,01	107 726,43	8 666,43	0,22%	0,19%
XS2705604234	SANTAN 4.875% 10/31 EMTN	EUR	100 000	99,379	106,629	99 379	106 628,6	959,02	107 587,62	8 208,62	0,22%	0,19%
XS2715302001	GIVNVX 4.125% 11/33	EUR	100 000	99,775	106,724	99 775	106 723,86	349,39	107 073,25	7 298,25	0,22%	0,19%
XS2723549528	SGOFP 3.75% 11/26 EMTN	EUR	100 000	99,883	101,708	99 883	101 707,9	307,38	102 015,28	2 132,28	0,20%	0,18%
XS2723593187	IHGLN 4.375% 11/29 EMTN	EUR	100 000	99,113	103,737	99 113	103 737,12	370,56	104 107,68	4 994,68	0,21%	0,19%
XS2726256113	CABKSM 4.375% 11/33 EMTN	EUR	100 000	99,113	105,218	99 113	105 218,42	358,61	105 577,03	6 464,03	0,21%	0,19%
XS2726263911	MCD 4.125% 11/35 GMTN	EUR	100 000	98,89	105,536	98 890	105 536,11	349,39	105 885,5	6 995,5	0,21%	0,19%
XS2726335099	ROSW 3.586% 12/36	EUR	100 000	100	105,904	100 000	105 903,54	244,95	106 148,49	6 148,49	0,21%	0,19%
XS2726461986	CCEP 3.875% 12/30	EUR	200 000	99,747	103,808	199 494	207 615,35	592,9	208 208,25	8 714,25	0,42%	0,38%
OBLIGATIONS FONCIERES						182 100	187 706,4		190 245,44	8 145,44	0,38%	0,34%
FR0013284205	GFCFP 1.375% 01/28	EUR	200 000	91,05	93,853	182 100	187 706,4	2 539,04	190 245,44	8 145,44	0,38%	0,34%
SECTEUR PRIVE CORPORATE DETTE SENIOR						923 853	946 961,53		953 286,22	29 433,22	1,91%	1,72%
FR0013357845	MLFP 0.875% 09/25 EUR	EUR	100 000	94,829	96,392	94 829	96 392,16	279,71	96 671,87	1 842,87	0,19%	0,17%
FR0013396876	SUFP 1.5% 01/28 EMTN	EUR	200 000	94,022	95,444	188 044	190 888,05	2 860,27	193 748,32	5 704,32	0,39%	0,35%
FR0013506862	SUFP 1% 04/27 EMTN	EUR	100 000	92,804	94,775	92 804	94 775,13	721,31	95 496,44	2 692,44	0,19%	0,17%
XS1120892507	TELEFO 2.932% 10/29	EUR	300 000	97,676	99,111	293 028	297 331,57	1 754,39	299 085,96	6 057,96	0,60%	0,54%
XS1681519184	GSK 1% 09/26	EUR	100 000	93,888	95,448	93 888	95 447,55	295,08	95 742,63	1 854,63	0,19%	0,17%
XS2187525949	ALLRNV 0.375% 06/30 EMTN	EUR	200 000	80,63	86,064	161 260	172 127,07	413,93	172 541	11 281	0,35%	0,31%
SECTEUR PRIVE FINANCIER DETTE SENIOR						1 272 072	1 341 441,64		1 348 256,12	76 184,12	2,71%	2,44%
FR0013170834	FDRFP 1.875% 05/26	EUR	200 000	94,105	96,389	188 209	192 778,47	2 284,84	195 063,31	6 854,31	0,39%	0,35%
FR0013368602	SOCGEN 2.125% 09/28 EMTN	EUR	100 000	90,278	94,573	90 278	94 573,16	539,96	95 113,12	4 835,12	0,19%	0,17%
FR0013422011	BNP 1.375% 05/29 EMTN	EUR	200 000	84,836	90,084	169 672	180 167,97	1 615,44	181 783,41	12 111,41	0,37%	0,33%
FR0013430741	LIFP 0.625% 07/30 EMTN	EUR	500 000	76,354	83,529	381 770	417 644,76	1 545,42	419 190,18	37 420,18	0,84%	0,76%
FR0013444304	HSBC 0.1% 09/27 EMTN	EUR	300 000	87,026	89,824	261 078	269 472	95,9	269 567,9	8 489,9	0,54%	0,49%



# 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						47 491 875,14	49 226 082,71		49 782 085,18	2 290 210,04	100,00%	89,98%
Obligation Taux Fixe						36 837 555,1	38 126 813,14		38 554 047,22	1 716 492,12	77,45%	69,69%
SECTEUR PRIVE FINANCIER DETTE SENIOR						1 272 072	1 341 441,64		1 348 256,12	76 184,12	2,71%	2,44%
XS1856834608	BFCM 1.375% 07/28 EMTN	EUR	100 000	89,285	93,018	89 285	93 018,23	623,63	93 641,86	4 356,86	0,19%	0,17%
XS2081018629	ISPIM 1% 11/26 EMTN	EUR	100 000	91,78	93,787	91 780	93 787,05	109,29	93 896,34	2 116,34	0,19%	0,17%
Obligation Taux Variable						8 590 160,48	8 921 949,57		9 050 717,96	460 557,48	18,18%	16,36%
-						8 298 340,48	8 624 841,28		8 749 505,84	451 165,36	17,58%	15,81%
AT0000A2KW37	ERSTBK VAR 11/28 EMTN	EUR	200 000	85,76	88,397	171 520	176 794,53		176 818,03	5 298,03	0,36%	0,32%
CH0520042489	UBS VAR 01/26 EMTN	EUR	200 000	92,2	95,876	184 400	191 752,94	457,53	192 210,47	7 810,47	0,39%	0,35%
CH1194000357	UBS VAR 06/30 EMTN	EUR	200 000	93,115	97,422	186 230	194 843,26	3 364,07	198 207,33	11 977,33	0,40%	0,36%
CH1236363391	UBS VAR 01/31 EMTN	EUR	200 000	99,073	103,366	198 146	206 731,18	8 438,36	215 169,54	17 023,54	0,43%	0,39%
CH1255915006	UBS GROUP 23-17/03/2028 FRN	EUR	200 000	100,5	102,948	201 000	205 896,06	7 253,42	213 149,48	12 149,48	0,43%	0,39%
DE000A2YPFA1	ALVGR VAR 09/49	EUR	200 000	80,2	86,466	160 400	172 932,56	675,38	173 607,94	13 207,94	0,35%	0,31%
DE000CB0HRQ9	CMZB VAR 03/26 EMTN	EUR	100 000	92,817	96,037	92 817	96 036,54	573,77	96 610,31	3 793,31	0,19%	0,17%
DE000CZ45W57	CMZB VAR 09/27	EUR	100 000	94,422	97,984	94 422	97 983,95	868,85	98 852,8	4 430,8	0,20%	0,18%
FR0013291556	CMARK 1.875% 10/29	EUR	100 000	95,261	97,395	95 261	97 395,37	332,99	97 728,36	2 467,36	0,20%	0,18%
FR0013463775	CNPPF VAR 07/50	EUR	200 000	81,78	86,954	163 560	173 907,05	1 693,99	175 601,04	12 041,04	0,35%	0,32%
FR0013509098	SOCGEN VAR 04/26 EMTN	EUR	100 000	94,121	96,553	94 121	96 553,49	774,59	97 328,08	3 207,08	0,20%	0,18%
FR0014000517	ORAFP VAR PERP EMTN	EUR	200 000	84,417	88,935	168 834	177 870,08	717,21	178 587,29	9 753,29	0,36%	0,32%
FR0014000022	SOCGEN VAR 11/30 EMTN	EUR	100 000	88,572	93,885	88 572	93 885,15	95,63	93 980,78	5 408,78	0,19%	0,17%
FR0014001GA9	SOCGEN VAR 06/29	EUR	300 000	82,143	86,836	246 428	260 507,89	819,67	261 327,56	14 899,56	0,52%	0,47%
FR0014002QE8	SOCGEN VAR 06/31 EMTN	EUR	100 000	86,98	92,04	86 980	92 040,44	559,43	92 599,87	5 619,87	0,19%	0,17%
FR0014006IU2	SOCGEN VAR 11/26	EUR	200 000	91,03	93,912	182 060	187 824,32	28,69	187 853,01	5 793,01	0,38%	0,34%
FR0014006XA3	SOCGEN VAR 12/27	EUR	200 000	87,364	91,753	174 728	183 505,39	92,21	183 597,6	8 869,6	0,37%	0,33%
FR0014007VJ6	BPCEGP VAR 02/34 EMTN	EUR	300 000	81,109	88,255	243 327	264 764,46	4 746,58	269 511,04	26 184,04	0,54%	0,49%
FR0014008PC1	BPCEGP VAR 03/32 EMTN	EUR	100 000	90,29	93,73	90 290	93 729,89	1 856,56	95 586,45	5 296,45	0,19%	0,17%
FR0014009HA0	BNP VAR 03/32 EMTN	EUR	200 000	89,25	94,761	178 500	189 521,7	3 729,51	193 251,21	14 751,21	0,39%	0,35%
FR001400AY79	BFCM VAR 06/32	EUR	700 000	94,705	98,934	662 934	692 538,82	14 525,96	707 064,78	44 130,78	1,42%	1,28%
FR001400KZQ1	SOCGEN VAR 09/29	EUR	100 000	99,483	104,311	99 483	104 310,61	1 193,99	105 504,6	6 021,6	0,21%	0,19%
XS1115800655	ASRNED VAR PERP (5%)	EUR	100 000	99,25	100,22	99 250	100 220,24	1 229,51	101 449,75	2 199,75	0,20%	0,18%
XS1180651587	ACHMEA VAR PERP(4.25%)	EUR	100 000	98	99,299	98 000	99 299,09	3 819,18	103 118,27	5 118,27	0,21%	0,19%
XS2011260531	MRKGR VAR 06/79 .	EUR	100 000	95,498	97,577	95 498	97 577,35	48,84	97 626,19	2 128,19	0,20%	0,18%
XS2080205367	NWG VAR 11/25	EUR	100 000	94,948	97,262	94 948	97 262,06	90,16	97 352,22	2 404,22	0,20%	0,18%
XS2148623106	LLOYDS VAR 04/26 EMTN	EUR	300 000	99,277	99,735	297 831	299 204,05	7 803,28	307 007,33	9 176,33	0,62%	0,55%
XS2218405772	MRKGR VAR 09/80	EUR	100 000	89,155	93,12	89 155	93 119,83	492,83	93 612,66	4 457,66	0,19%	0,17%
XS2225204010	VOD VAR 08/80	EUR	100 000	81,24	89,669	81 240	89 669,24	1 016,39	90 685,63	9 445,63	0,18%	0,16%
XS2251736646	HSBC VAR 11/26 GEN	EUR	200 000	91,554	94,285	183 108	188 570,94	77,67	188 648,61	5 540,61	0,38%	0,34%
XS2312744217	ENELIM VAR PERP 6.5Y	EUR	100 000	81,33	87,582	81 330	87 582,19	420,77	88 002,96	6 672,96	0,18%	0,16%

# 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						47 491 875,14	49 226 082,71		49 782 085,18	2 290 210,04	100,00%	89,98%
Obligation Taux Variable						8 590 160,48	8 921 949,57		9 050 717,96	460 557,48	18,18%	16,36%
-						8 298 340,48	8 624 841,28		8 749 505,84	451 165,36	17,58%	15,81%
XS2320745156	HANRUE VAR 06/42	EUR	100 000	73,119	81,036	73 119	81 036,37	683,74	81 720,11	8 601,11	0,16%	0,15%
XS2381261424	MUNRE VAR 05/42	EUR	100 000	71,159	79,094	71 159,33	79 093,51	592,9	79 686,41	8 527,08	0,16%	0,14%
XS2388491289	HSBC VAR 09/29	EUR	200 000	83,424	87,861	166 848	175 721,52	336,26	176 057,78	9 209,78	0,35%	0,32%
XS2432567555	DNBNO VAR 01/28 EMTN	EUR	100 000	89,393	91,709	89 393	91 708,85	354,45	92 063,3	2 670,3	0,18%	0,17%
XS2486092492	DNBNO VAR 05/26 EMTN	EUR	100 000	95,89	97,412	95 890	97 412,24	941,26	98 353,5	2 463,5	0,20%	0,18%
XS2486589596	HSBC VAR 06/27	EUR	300 000	96,68	98,828	290 040	296 485,28	4 874,94	301 360,22	11 320,22	0,61%	0,54%
XS2521027446	LLOYDS VAR 08/30 EMTN	EUR	200 000	94,695	97,52	189 390	195 040,9	2 168,72	197 209,62	7 819,62	0,40%	0,36%
XS2528858033	NWG VAR 09/28 EMTN	EUR	200 000	99,629	101,927	199 258	203 853,07	2 533,54	206 386,61	7 128,61	0,41%	0,37%
XS2534985523	DNBNO VAR 09/27 EMTN	EUR	100 000	98,81	99,756	98 810	99 755,55	845,29	100 600,84	1 790,84	0,20%	0,18%
XS2553801502	SABSM VAR 11/28 EMTN	EUR	300 000	101,98	105,232	305 940	315 697,38	2 058,4	317 755,78	11 815,78	0,64%	0,57%
XS2588099478	DNBNO VAR 02/27 EMTN	EUR	200 000	99,668	100,367	199 336	200 734,52	6 276,71	207 011,23	7 675,23	0,42%	0,37%
XS2597114284	HSBC VAR 03/32 EMTN	EUR	100 000	100,299	105,958	100 299	105 958,3	3 855,83	109 814,13	9 515,13	0,22%	0,20%
XS2597696124	DNBNO VAR 03/29 EMTN	EUR	100 000	102,21	103,157	102 210	103 157,46	3 169,4	106 326,86	4 116,86	0,21%	0,19%
XS2598331242	SABSM VAR 06/29 EMTN	EUR	100 000	99,521	105,22	99 521	105 219,79	2 800,55	108 020,34	8 499,34	0,22%	0,20%
XS2613658041	RABOBK VAR 04/29 GMTN	EUR	200 000	99,932	102,994	199 864,5	205 987,85	5 736,52	211 724,37	11 859,87	0,43%	0,38%
XS2616652637	NNGRNV VAR 11/43 EMTN	EUR	100 000	99,655	106,908	99 655	106 907,86	757,84	107 665,7	8 010,7	0,22%	0,19%
XS2620201421	BBVASM VAR 05/26 GMTN	EUR	200 000	99,928	100,664	199 856	201 328,03	5 252,05	206 580,08	6 724,08	0,41%	0,37%
XS2623501181	CABKSM VAR 05/27 EMTN	EUR	200 000	99,825	102,14	199 650	204 280,77	5 737,02	210 017,79	10 367,79	0,42%	0,38%
XS2623518821	NWG VAR 02/29 EMTN	EUR	135 000	99,999	104,073	134 998,65	140 498,19	4 005,68	144 503,87	9 505,22	0,29%	0,26%
XS2632933631	BMO FRN 06/25 EMTN	EUR	200 000	100	100,292	200 000	200 584,57	563,76	201 148,33	1 148,33	0,40%	0,36%
XS2636592102	BBVASM VAR 09/33 GMTN	EUR	200 000	99,365	105,274	198 730	210 548,6	3 299,18	213 847,78	15 117,78	0,43%	0,39%
OBLIGATIONS INDEXEES ET PARTICIPANTES						100 490	102 302,17		103 518,02	3 028,02	0,21%	0,19%
XS1115498260	ORAFP VAR PERP(5%)	EUR	100 000	100,49	102,302	100 490	102 302,17	1 215,85	103 518,02	3 028,02	0,21%	0,19%
SECTEUR PRIVE FINANCIER DETTE SENIOR						191 330	194 806,12		197 694,1	6 364,1	0,40%	0,36%
XS1788515606	NWG VAR 03/26 EMTN	EUR	200 000	95,665	97,403	191 330	194 806,12	2 887,98	197 694,1	6 364,1	0,40%	0,36%
<b>Total</b>						<b>52 914 405,09</b>	<b>54 769 322,9</b>	<b>556 002,47</b>	<b>55 325 325,37</b>	<b>2 410 920,28</b>		

# Avertissement

*Cette communication publicitaire est destinée exclusivement à la présentation des Organismes de Placement Collectif (OPC) et/ou FCPE gérés par SIENNA GESTION et ne contient aucune information d'ordre contractuel.*

*Aucune souscription dans les OPC gérés par la société de gestion SIENNA GESTION ne saurait se faire sur la base des seules informations figurant sur ce document. La souscription dans les OPC décrits doit se faire selon les dispositions légales et réglementaires en vigueur. Toute personne envisageant une souscription doit notamment prendre connaissance du DIC PRIIPs et du Règlement du ou des OPC, disponibles sur le site [www.sienna-gestion.com](http://www.sienna-gestion.com).*

*En conséquence, SIENNA GESTION ne saurait être tenue responsable de toute décision d'investissement réalisée sur la seule base de cette présentation.*

*Le document ne constitue en aucun cas une offre ou une sollicitation en vue de la fourniture de services de conseils en investissement ou de la vente d'instruments financiers. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures et ne sont pas constantes dans le temps. La référence à certaines valeurs ou instruments financiers est donnée à titre d'illustration pour mettre en avant certaines valeurs présentes ou qui ont été présentes dans les portefeuilles des Fonds SIENNA GESTION. Elle n'a pas pour objectif de promouvoir l'investissement en direct dans ces instruments, et ne constitue pas un conseil en investissement. Sienna Gestion s'efforce d'assurer l'exactitude des informations communiquées mais ne peut cependant en garantir l'exhaustivité et décline toute responsabilité en cas d'omission, ou d'erreur dans ces informations.*

*SIENNA GESTION, membre du groupe SIENNA INVESTMENT MANAGERS, société de gestion agréée par l'AMF, assure la gestion des FCPE (Fonds communs de placement entreprise) disponibles en épargne salariale, d'OPCVM, de FIVG et des mandats institutionnels ainsi que l'ensemble des prestations financières qui leur sont liées.*

*Les OPC gérés par SIENNA GESTION ne sont pas destinés aux résidents ou citoyens des Etats-Unis d'Amérique et des « U.S. Persons », telle que cette expression est définie par l'U.S. Securities Act 1933.*

**SIENNA GESTION**, membre du groupe SIENNA INVESTMENT MANAGERS | Société anonyme à Directoire et Conseil de surveillance au capital de 9 824 748 € | RCS : 320 921 828 Paris | N° Agrément AMF : GP 97020 en date du 13 mars 1997 | N° TVA intracommunautaire : FR 47 320 921 828 | Code APE : 6430Z | Siège social : 18 rue de Courcelles 75008 Paris | [www.sienna-gestion.com](http://www.sienna-gestion.com)

# Avertissement

*Cette communication publicitaire est un document exclusivement destiné à la présentation de FCPE. Il n'a aucunement vocation à être transmis, sous quelque forme que ce soit à l'ensemble des salariés d'une entreprise. Il ne contient aucune information d'ordre contractuel.*

*Aucune souscription dans les FCPE gérés par la société de gestion SIENNA GESTION ne saurait se faire sur la base des seules informations figurant sur ce document. La souscription dans les FCPE décrits doit se faire selon les dispositions légales et réglementaires en vigueur. Toute personne envisageant une souscription doit notamment prendre connaissance du DIC PRIIPs et du Règlement du ou des FCPE, disponibles sur le site internet [www.epsens.com](http://www.epsens.com).*

*En conséquence, EPSENS et SIENNA GESTION ne sauraient être tenus responsables de toute décision d'investissement réalisée sur la seule base de cette présentation. Le document ne constitue en aucun cas une offre ou une sollicitation en vue de la fourniture de services de conseils en investissement ou de la vente d'instruments financiers. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures et ne sont pas constantes dans le temps.*

*La référence à certaines valeurs ou instruments financiers est donnée à titre d'illustration pour mettre en avant certaines valeurs présentes ou qui ont été présentes dans les portefeuilles des Fonds SIENNA GESTION. Elle n'a pas pour objectif de promouvoir l'investissement en direct dans ces instruments, et ne constitue pas un conseil en investissement. Sienna Gestion s'efforce d'assurer l'exactitude des informations communiquées mais ne peut cependant en garantir l'exhaustivité et décline toute responsabilité en cas d'omission, ou d'erreur dans ces informations.*

*SIENNA GESTION, membre du groupe SIENNA INVESTMENT MANAGERS, société de gestion agréée par l'AMF, assure la gestion des FCPE (Fonds communs de placement entreprise) disponibles en épargne salariale, d'OPCVM, de FIVG et des mandats institutionnels ainsi que l'ensemble des prestations financières qui leur sont liées.*

*Les FCPE gérés par SIENNA GESTION ne sont pas destinés aux résidents ou citoyens des Etats-Unis d'Amérique et des « U.S. Persons », telle que cette expression est définie par l'U.S. Securities Act 1933.*

**TENEUR DE COMPTES ET CONSERVATEUR DE PARTS : EPSENS** - Entreprise d'investissement agréée en France par l'ACPR | Code Banque CIB : 11 383 - Société Anonyme au capital de 20 376 960,40 € | 538 045 964 R.C.S. Paris | N° TVA intracommunautaire : FR 92 538 045 964 | Siège social : 21 rue Laffitte 75317 Paris Cedex 09

**SOCIÉTÉ DE GESTION : SIENNA GESTION**, membre du groupe SIENNA INVESTMENT MANAGERS | Société anonyme à Directoire et Conseil de surveillance au capital de 9 824 748 € | RCS : 320 921 828 Paris | N° Agrément AMF : GP 97020 en date du 13 mars 1997 | N° TVA intracommunautaire : FR 47 320 921 828 | Code APE : 6430Z | Siège social : 18 rue de Courcelles 75008 Paris | [www.sienna-gestion.com](http://www.sienna-gestion.com)

