

# SIENNA SOUVERAIN 5-7 ISR

Inventaire  
du 30 décembre 2022

# Portefeuille

CodeTitre	LibelléTitre	Devise	Quantité	Prix Revient Unitaire	Cours	Prix Revente Global	VB Coupon Exclu	Coupon Couru	Valeur Boursière	Plus Ou Moins Values	% Poche	% Actif
Autre						0	-5 061 068,84		-5 061 068,84	-5 061 068,84	100,00%	-2,01%
Future sur obligation						0	-5 061 068,84		-5 061 068,84	-5 061 068,84	100,00%	-2,01%
-						0	-5 061 068,84		-5 061 068,84	-5 061 068,84	100,00%	-2,01%
CDU___H3	EURO SCHATZ 0323	EUR	-390	106,665	105,42	0	485 550	0	485 550	485 550	-9,59%	0,19%
COE___H3	EURO BOBL 0323	EUR	66	119,67	115,75	0	-258 720	0	-258 720	-258 720	5,11%	-0,10%
CRX___H3	FGBL BUND 10A 0323	EUR	590	141,893	132,93	0	-5 287 898,84	0	-5 287 898,84	-5 287 898,84	104,48%	-2,10%
Off set Future sur obligation						0	0		0	0	0,00%	0,00%
-						0	0		0	0	0,00%	0,00%
OFSCDU___H3	EURO SCHATZ 0323 OFFSET	EUR	41 599 350				0			0	0,00%	0,00%
OFSCOE___H3	EURO BOBL 0323 OFFSET	EUR	-7 898 220				0			0	0,00%	0,00%
OFSCRX___H3	FGBL BUND 10A 0323 OFFSET	EUR	-83 716 598,84				0			0	0,00%	0,00%
Monétaire & Liquidité						22 653 393,6	31 029 065,32		31 029 065,32	8 375 671,72	100,00%	12,35%
Devise						246 841,88	8 611 003,22		8 611 003,22	8 364 161,34	27,75%	3,43%
-						246 841,88	8 611 003,22		8 611 003,22	8 364 161,34	27,75%	3,43%
CASH_EUR	Euro	EUR	8 611 003,22	1	1	246 841,88	8 611 003,22	0	8 611 003,22	8 364 161,34	27,75%	3,43%
OPCVM Monétaire						22 406 551,72	22 418 062,1		22 418 062,1	11 510,38	72,25%	8,92%
OPCVM COURT TERME						22 406 551,72	22 418 062,1		22 418 062,1	11 510,38	72,25%	8,92%
FR0007081278	SIENNA MONETAIRE ISR A	EUR	191 245	117,162	117,222	22 406 551,72	22 418 062,1	0	22 418 062,1	11 510,38	72,25%	8,92%
Obligation						253 085 153,67	222 085 985,33		225 267 107,32	-27 818 046,35	100,00%	89,66%
Obligation Taux Fixe						165 959 112,28	145 428 858,82		147 161 045,96	-18 798 066,32	65,33%	58,58%
-						19 934 777,8	18 674 626,07		18 762 368,56	-1 172 409,24	8,33%	7,47%
EU000A3KTGV8	EU 0% 07/26 NGEU	EUR	10 000 000	101,984	90,121	10 198 430	9 012 133,5	0	9 012 133,5	-1 186 296,5	4,00%	3,59%
FR001400E904	RENAUL 4.125% 12/25 EMTN	EUR	409 000	99,748	99,301	407 969,32	406 141,31	1 525,35	407 666,66	-302,66	0,18%	0,16%
FR001400E946	CMARK 4.25% 12/32 EMTN	EUR	1 700 000	99,187	98,616	1 686 179	1 676 473,02	6 532,19	1 683 005,21	-3 173,79	0,75%	0,67%
XS2531420656	ENELIM 3.875% 03/29 EMTN	EUR	6 000 000	99,63	98,812	5 977 800	5 928 706,74	73 890,41	6 002 597,15	24 797,15	2,66%	2,39%
XS2560411543	ACHMEA 3.625% 11/25	EUR	1 667 000	99,844	99,05	1 664 399,48	1 651 171,5	5 794,54	1 656 966,04	-7 433,44	0,74%	0,66%
FONDS D'ETAT						141 940 794,48	123 174 366,67		124 804 582,39	-17 136 212,09	55,40%	49,68%
AT0000383864	AUSTRIA 6.25% 07/27	EUR	1 000 000	147,042	114,597	1 470 425	1 145 969,93	29 452,05	1 175 421,98	-295 003,02	0,52%	0,47%
BE0000291972	BELGIUM 5.50% 03/28	EUR	1 000 000	145,034	112,993	1 450 340	1 129 927,27	42 342,47	1 172 269,74	-278 070,26	0,52%	0,47%
DE0001030542	DBRI IE 0.1% 4/23	EUR	15 000 000	118,307	99,227	17 746 095,57	18 578 831	13 491,25	18 592 322,25	846 226,68	8,25%	7,40%
DE0001135085	DBR 4.75% 04/07/28	EUR	22 000 000	113,916	111,207	25 061 422,22	24 465 523,5	523 931,51	24 989 455,01	-71 967,21	11,09%	9,95%
ES0000012A89	SPAIN 1.45% 10/27	EUR	6 000 000	110,213	92,501	6 612 772,5	5 550 084,48	15 254,79	5 565 339,27	-1 047 433,23	2,47%	2,22%
ES0000012B88	SPAIN 1.4% 07/28	EUR	11 000 000	110,356	90,895	12 139 120,71	9 998 460,67	66 241,1	10 064 701,77	-2 074 418,94	4,47%	4,01%
FR0013510724	BPIFRA 0.125% 02/27	EUR	2 100 000	99,197	88,097	2 083 137	1 850 038,94	2 236,64	1 852 275,58	-230 861,42	0,82%	0,74%
IE00BKFCV568	IRELAND 0.2% 05/27	EUR	1 750 000	102,309	89,31	1 790 415	1 562 925,49	2 234,25	1 565 159,74	-225 255,26	0,69%	0,62%

# Portefeuille

CodeTitre	LibelléTitre	Devise	Quantité	Prix Revient Unitaire	Cours	Prix Revent Global	VB Coupon Exclu	Coupon Couru	Valeur Boursière	Plus Ou Moins Values	% Poche	% Actif
Obligation						253 085 153,67	222 085 985,33		225 267 107,32	-27 818 046,35	100,00%	89,66%
Obligation Taux Fixe						165 959 112,28	145 428 858,82		147 161 045,96	-18 798 066,32	65,33%	58,58%
FONDS D'ETAT						141 940 794,48	123 174 366,67		124 804 582,39	-17 136 212,09	55,40%	49,68%
IT0001086567	BTPS 7.25% 11/26	EUR	10 500 000	142,12	112,963	14 922 623,88	11 861 092,53	132 482,73	11 993 575,26	-2 929 048,62	5,32%	4,77%
IT0001174611	BTPS 6.50% 11/27	EUR	14 700 000	139,463	111,918	20 501 077,33	16 451 960,85	166 288,67	16 618 249,52	-3 882 827,81	7,38%	6,61%
IT0004889033	BTPS 4.75% 09/28	EUR	16 000 000	132,556	103,654	21 208 991,27	16 584 697,6	260 331,49	16 845 029,09	-4 363 962,18	7,48%	6,70%
NL0015031501	NEDERLD % 01/27	EUR	900 000	103,049	89,724	927 444	807 512,34	0	807 512,34	-119 931,66	0,36%	0,32%
PTOTEUOE0019	PORTUGAL 4.125% 04/27	EUR	12 600 000	127,198	104,661	16 026 930	13 187 342,07	375 928,77	13 563 270,84	-2 463 659,16	6,02%	5,40%
OBLIGATIONS DES COLLECTIVITES REGIONALES						4 083 540	3 579 866,08		3 594 095,01	-489 444,99	1,60%	1,43%
ES0000101966	MADRID 0.827% 07/27	EUR	4 000 000	102,088	89,497	4 083 540	3 579 866,08	14 228,93	3 594 095,01	-489 444,99	1,60%	1,43%
Obligation Taux Variable						87 126 041,39	76 657 126,51		78 106 061,36	-9 019 980,03	34,67%	31,09%
-						61 739 959,06	51 726 305,7		52 822 252,8	-8 917 706,26	23,45%	21,03%
BE0002597756	ELIASO VAR PERP	EUR	1 500 000	100,35	97,721	1 505 250	1 465 819,83	3 277,4	1 469 097,23	-36 152,77	0,65%	0,58%
FR0012444750	ACAFP VAR PERP(4.25%)	EUR	5 000 000	101,95	97,596	5 097 500	4 879 816,95	206 678,08	5 086 495,03	-11 004,97	2,26%	2,02%
FR0013431244	ENGIFP VAR PERP	EUR	2 000 000	94	91,865	1 880 000	1 837 299,9	15 938,36	1 853 238,26	-26 761,74	0,82%	0,74%
FR0013478252	AKEFP VAR PERP	EUR	2 000 000	92,8	84,727	1 856 000	1 694 539,04	28 520,55	1 723 059,59	-132 940,41	0,76%	0,69%
PTEDPLOM0017	EDPPL VAR 07/80	EUR	2 200 000	92,25	89,642	2 029 500	1 972 125,45	17 111,78	1 989 237,23	-40 262,77	0,88%	0,79%
XS1028599287	ORAFP 5.25% PERP	EUR	1 000 000	104,97	101,019	1 049 700	1 010 185,65	47 465,75	1 057 651,4	7 951,4	0,47%	0,42%
XS1061711575	AEGON VAR 4/44	EUR	1 000 000	102,25	98,354	1 022 500	983 544,97	27 726,03	1 011 271	-11 229	0,45%	0,40%
XS1155697243	LAMON VAR PERP(5.05%)	EUR	3 000 000	105,6	99,249	3 168 000	2 977 473,24	7 056,16	2 984 529,4	-183 470,6	1,32%	1,19%
XS1224953882	ERFFP VAR PERP(4.875%)	EUR	2 000 000	105	100,143	2 100 000	2 002 864,44	66 513,7	2 069 378,14	-30 621,86	0,92%	0,82%
XS1508392625	ALATPF VAR PERP(3.75%)	EUR	6 600 000	103,22	50,576	6 812 545,06	3 338 040,16	235 972,6	3 574 012,76	-3 238 532,3	1,59%	1,42%
XS1590823859	INTNED 3% 11/04/28	EUR	1 700 000	101,232	99,584	1 720 944	1 692 927,27	37 306,85	1 730 234,12	9 290,12	0,77%	0,69%
XS1591694481	TENN FRN PERP	EUR	1 400 000	100,49	97,428	1 406 860	1 363 989,68	24 813,37	1 388 803,05	-18 056,95	0,62%	0,55%
XS1645495349	CABKSM 2.75% 14/07/28	EUR	7 000 000	98,15	98,194	6 870 500	6 873 562,92	91 239,73	6 964 802,65	94 302,65	3,09%	2,77%
XS1716927766	FERSM VAR PERP	EUR	3 500 000	99,9	79,905	3 496 500	2 796 682,24	47 659,07	2 844 341,31	-652 158,69	1,26%	1,13%
XS1752984440	ARNDTN VAR PERP	EUR	5 000 000	95,988	37,522	4 799 400	1 876 116,9	102 174,66	1 978 291,56	-2 821 108,44	0,88%	0,79%
XS1811181566	GYCGR VAR PERP	EUR	800 000	101,74	45,613	813 920	364 905,74	3 890,41	368 796,15	-445 123,85	0,16%	0,15%
XS1967697738	DANBNK VAR 06/29 EMTN	EUR	1 500 000	100,12	96,021	1 501 800	1 440 313,39	20 136,99	1 460 450,38	-41 349,62	0,65%	0,58%
XS1982704824	CPIPGR VAR PERP	EUR	1 500 000	91	51,608	1 365 000	774 119,03	15 827,05	789 946,08	-575 053,92	0,35%	0,31%
XS2242929532	ENIIM VAR PERP NC5.	EUR	3 000 000	95,62	90,843	2 868 600	2 725 302,03	76 592,47	2 801 894,5	-66 705,5	1,24%	1,12%
XS2338355105	GS VAR 04/24 EMTN	EUR	4 000 000	99,951	98,82	3 998 040	3 952 780,56	271,78	3 953 052,34	-44 987,66	1,75%	1,57%
XS2343563214	SWEDA VAR 05/27	EUR	5 000 000	100,43	87,477	5 021 500	4 373 837,6	9 369,86	4 383 207,46	-638 292,54	1,95%	1,74%
XS2462605671	TELEFO VAR PERP	EUR	1 300 000	104,3	102,312	1 355 900	1 330 058,71	10 404,45	1 340 463,16	-15 436,84	0,60%	0,53%

# 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						253 085 153,67	222 085 985,33		225 267 107,32	-27 818 046,35	100,00%	89,66%
Obligation Taux Variable						87 126 041,39	76 657 126,51		78 106 061,36	-9 019 980,03	34,67%	31,09%
OBLIGATIONS INDEXEES ET PARTICIPANTES						21 438 242,33	20 958 136,17		21 238 795,15	-199 447,18	9,43%	8,45%
FR0013292828	BNFP FRN PERP	EUR	3 000 000	99,743	98,817	2 992 300	2 964 502,8	27 904,11	2 992 406,91	106,91	1,33%	1,19%
FR0013299468	CRLOG VAR 11/29	EUR	1 000 000	99,613	92,387	996 130	923 873,48	1 331,51	925 204,99	-70 925,01	0,41%	0,37%
FR0013367612	EDF VAR PERP	EUR	4 000 000	97,44	94,073	3 897 600	3 762 904,24	39 890,41	3 802 794,65	-94 805,35	1,69%	1,51%
XS1150695192	VLVY VAR 03/78(4.85%)	EUR	1 000 000	105,1	99,736	1 051 000	997 363,08	39 730,14	1 037 093,22	-13 906,78	0,46%	0,41%
XS1501167164	TOTAL VAR 12/49(2.708%)	EUR	5 760 000	100,15	99,179	5 768 634	5 712 700,61	103 844,75	5 816 545,36	47 911,36	2,58%	2,32%
XS1590787799	TELIAS FRN 04/78	EUR	327 000	101,547	99,729	332 059,58	326 114,8	7 364,22	333 479,02	1 419,44	0,15%	0,13%
XS1721244371	IBESM VAR PERP	EUR	5 000 000	101,69	99,481	5 084 518,75	4 974 065,7	58 047,95	5 032 113,65	-52 405,1	2,23%	2,00%
XS2035564975	ENBW VAR 11/79	EUR	1 400 000	94	92,615	1 316 000	1 296 611,46	2 545,89	1 299 157,35	-16 842,65	0,58%	0,52%
SECTEUR PRIVE FINANCIER DETTE SUBORDONNE						3 947 840	3 972 684,64		4 045 013,41	97 173,41	1,80%	1,61%
XS1678970291	BARC 2% 02/28	EUR	4 000 000	98,696	99,317	3 947 840	3 972 684,64	72 328,77	4 045 013,41	97 173,41	1,80%	1,61%
<b>Total</b>						<b>275 738 547,27</b>	<b>248 053 981,81</b>	<b>3 181 121,99</b>	<b>251 235 103,8</b>	<b>-24 503 443,47</b>		