

SIENNA CREDIT ISR

Inventaire
du 30 décembre 2022

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	-97 200		-97 200	-97 200	100,00%	-0,14%
Future sur obligation						0	-97 200		-97 200	-97 200	100,00%	-0,14%
-						0	-97 200		-97 200	-97 200	100,00%	-0,14%
CRX__H3	FGBL BUND 10A 0323	EUR	30	136,17	132,93	0	-97 200	0	-97 200	-97 200	100,00%	-0,14%
Offset Future sur obligation						0	0		0	0	0,00%	0,00%
-						0	0		0	0	0,00%	0,00%
OFSCRX__H3	FGBL BUND 10A 0323 OFFSET	EUR	-4 085 100				0			0	0,00%	0,00%
Monétaire & Liquidité						6 237 106,12	6 410 163,22		6 410 163,22	173 057,1	100,00%	8,93%
Devise						257 077,15	426 050,66		426 050,66	168 973,51	6,65%	0,59%
-						257 077,15	426 050,66		426 050,66	168 973,51	6,65%	0,59%
CASH_EUR	Euro	EUR	426 050,66	1	1	257 077,15	426 050,66	0	426 050,66	168 973,51	6,65%	0,59%
OPCVM Monétaire						5 980 028,97	5 984 112,56		5 984 112,56	4 083,59	93,35%	8,33%
-						3 000 000	3 000 000		3 000 000	0	46,80%	4,18%
FR001400EBN2	SIENNA TRESORERIE PLUS PA	EUR	3 000	1 000	1 000	3 000 000	3 000 000	0	3 000 000	0	46,80%	4,18%
OPCVM COURT TERME						2 980 028,97	2 984 112,56		2 984 112,56	4 083,59	46,55%	4,16%
FR0007081278	SIENNA MONETAIRE ISR A	EUR	25 457	117,061	117,222	2 980 028,97	2 984 112,56	0	2 984 112,56	4 083,59	46,55%	4,16%
Obligation						77 421 017,22	64 882 438,86		65 496 356,22	-11 924 661	100,00%	91,21%
Obligation Taux Fixe						54 748 030,71	45 677 791,79		46 006 853,79	-8 741 176,92	70,24%	64,07%
-						38 346 045,5	31 290 177,76		31 533 421,45	-6 812 624,05	48,15%	43,91%
BE6326784566	CCBGBB 0.125% 02/28 EMTN	EUR	1 000 000	99,743	83,474	997 430	834 737,47	1 126,71	835 864,18	-161 565,82	1,28%	1,16%
CH0595205524	UBS 0.25% 02/28	EUR	1 000 000	99,461	81,504	994 610	815 035,04	2 143,84	817 178,88	-177 431,12	1,25%	1,14%
FR0013283140	SEVFP 1.625% 09/32	EUR	1 000 000	103,104	80,57	1 031 040	805 699,17	4 630,14	810 329,31	-220 710,69	1,24%	1,13%
FR0013448859	SOCGEN 0.875% 09/29 EMTN	EUR	500 000	101,731	79,096	508 655	395 480,39	1 210,62	396 691,01	-111 963,99	0,61%	0,55%
FR00140005T0	AKEFP 0.125% 10/26 EMTN	EUR	1 000 000	100,387	87,922	1 003 874,5	879 222,92	277,4	879 500,32	-124 374,18	1,34%	1,22%
FR0014000UC8	ULFP 0.625% 05/27 EMTN	EUR	1 000 000	99,239	84,999	992 390	849 986,81	4 178,08	854 164,89	-138 225,11	1,30%	1,19%
FR0014001150	VIEFP % 01/27 EMTN	EUR	1 000 000	100,126	86,577	1 001 260	865 773,68	0	865 773,68	-135 486,32	1,32%	1,21%
FR00140044X1	FRLBP 0.75% 06/31 EMTN	EUR	1 000 000	99,598	74,432	995 980	744 316,25	3 986,3	748 302,55	-247 677,45	1,14%	1,04%
FR0014006ZC4	ORAFP 0.625% 12/33 EMTN	EUR	1 000 000	90,448	70,719	904 475	707 187,45	308,22	707 495,67	-196 979,33	1,08%	0,99%
FR0014007NF1	ICADFP 1% 01/30	EUR	1 000 000	95,18	73,651	951 800	736 506,47	9 561,64	746 068,11	-205 731,89	1,14%	1,04%
XS1142279782	TMO 2% 4/25	EUR	1 000 000	108,65	96,915	1 086 500	969 154,12	14 410,96	983 565,08	-102 934,92	1,50%	1,37%
XS1197833137	KO 1.625% 3/35	EUR	500 000	111,899	80,431	559 495	402 153,63	6 678,08	408 831,71	-150 663,29	0,62%	0,57%
XS1200679667	BRK 1.625% 3/35	EUR	500 000	79,955	76,505	399 775	382 524,38	6 522,26	389 046,64	-10 728,36	0,59%	0,54%
XS1226748512	BMV 1.75% 05/35	EUR	460 000	101,75	81,577	468 050	375 253,59	5 138,77	380 392,36	-87 657,64	0,58%	0,53%
XS1237271421	MCD 1.875% 5/27	EUR	1 000 000	110,79	93,402	1 107 900	934 023,12	11 404,11	945 427,23	-162 472,77	1,44%	1,32%
XS1513062411	MRK 1.375% 02/11/36	EUR	500 000	110,349	76,997	551 745	384 985,09	1 167,81	386 152,9	-165 592,1	0,59%	0,54%

Portefeuille

CodeTitre	LibelléTitre	Devise	Quantité	Prix Revient Unitaire	Cours	Prix Revient Global	VB Coupon Exclu	Coupon Couru	Valeur Boursière	Plus Ou Moins Values	% Poche	% Actif
Obligation						77 421 017,22	64 882 438,86		65 496 356,22	-11 924 661	100,00%	91,21%
Obligation Taux Fixe						54 748 030,71	45 677 791,79		46 006 853,79	-8 741 176,92	70,24%	64,07%
-						38 346 045,5	31 290 177,76		31 533 421,45	-6 812 624,05	48,15%	43,91%
XS1551068676	ENIIM 1.5 01/27	EUR	1 000 000	107,68	91,749	1 076 800	917 488,44	14 424,66	931 913,1	-144 886,9	1,42%	1,30%
XS1843434793	ITW 1% 06/31	EUR	1 000 000	90,219	81,716	902 190	817 156,21	5 808,22	822 964,43	-79 225,57	1,26%	1,15%
XS1955187932	SIEGR 1.75% 02/39 EMTN	EUR	200 000	103,945	79,011	207 890	158 022,17	2 963,01	160 985,18	-46 904,82	0,25%	0,22%
XS1960678412	MDT 1.625% 03/31	EUR	500 000	110,34	85,158	551 700	425 792,37	6 722,6	432 514,97	-119 185,03	0,66%	0,60%
XS1963745234	MCD 1.6% 03/31	EUR	1 000 000	101,593	84,053	1 015 930	840 530,11	12 887,67	853 417,78	-162 512,22	1,30%	1,19%
XS1967635977	ABESM 2.375% 09/27 EMTN	EUR	1 000 000	110,123	90,623	1 101 230	906 230,89	6 376,71	912 607,6	-188 622,4	1,39%	1,27%
XS2050406094	DHR 0.75% 09/31	EUR	500 000	101,15	77,839	505 750	389 194,63	1 099,32	390 293,95	-115 456,05	0,60%	0,54%
XS2051362312	AT&T 1.8% 09/39	EUR	500 000	98,625	69,313	493 125	346 567,41	2 736,99	349 304,4	-143 820,6	0,53%	0,49%
XS2058556619	TMO 0.875% 10/31	EUR	500 000	102,511	78,817	512 555	394 082,91	1 126,71	395 209,62	-117 345,38	0,60%	0,55%
XS2152796269	AIRFP 2% 04/28	EUR	825 000	111,194	92,999	917 350,5	767 240,95	12 250,68	779 491,63	-137 858,87	1,19%	1,09%
XS2177442295	TELEFO 1.807% 05/32 EMTN	EUR	1 000 000	93,328	81,77	933 280	817 701,54	11 238,05	828 939,59	-104 340,41	1,27%	1,15%
XS2187529180	PRIFII 1.625% 06/32 EMTN	EUR	500 000	98,324	75,61	491 620	378 050,08	4 452,05	382 502,13	-109 117,87	0,58%	0,53%
XS2198582301	TACHEM 2% 07/40	EUR	500 000	107,437	70,683	537 185	353 416,56	4 876,71	358 293,27	-178 891,73	0,55%	0,50%
XS2263684933	NESNVX 0.375% 12/40	EUR	500 000	90,109	58,392	450 545	291 960,36	159,25	292 119,61	-158 425,39	0,45%	0,41%
XS2265968284	SHBASS 0.01% 12/27 EMTN	EUR	1 000 000	99,958	82,932	999 580	829 317,79	8,77	829 326,56	-170 253,44	1,27%	1,15%
XS2289133915	UCGIM 0.325% 01/26 EMTN	EUR	1 000 000	99,891	88,939	998 910	889 394,84	3 107,53	892 502,37	-106 407,63	1,36%	1,24%
XS2289877941	TSCOLN 0.375% 07/29 EMTN	EUR	600 000	99,335	77,369	596 010	464 213,67	986,3	465 199,97	-130 810,03	0,71%	0,65%
XS2290544068	CPIPGR 1.5% 01/31 EMTN	EUR	1 000 000	87,75	57,951	877 500	579 514,42	14 013,7	593 528,12	-283 971,88	0,91%	0,83%
XS2305244241	LPTY 0.25% 02/26 EMTN	EUR	1 000 000	99,614	87,031	996 140	870 313,54	2 150,68	872 464,22	-123 675,78	1,33%	1,21%
XS2312722916	MDLZ 0.25% 03/28	EUR	1 000 000	90,08	83,369	900 800	833 692,32	2 000	835 692,32	-65 107,68	1,28%	1,16%
XS2312723302	MDLZ 1.375% 03/41	EUR	500 000	97,052	65,258	485 260	326 292,33	5 500	331 792,33	-153 467,67	0,51%	0,46%
XS2320759538	VZ 0.375% 03/29	EUR	1 000 000	99,67	80,603	996 700	806 030,12	2 948,63	808 978,75	-187 721,25	1,24%	1,13%
XS2337252931	FDX 0.45% 05/29	EUR	500 000	99,684	79,325	498 420	396 623,88	1 504,11	398 127,99	-100 292,01	0,61%	0,55%
XS2337253319	FDX 0.95% 05/33	EUR	500 000	89,96	71,328	449 800	356 639,85	3 175,34	359 815,19	-89 984,81	0,55%	0,50%
XS2343114687	ERFFP 0.875% 05/31	EUR	500 000	99,999	75,3	499 992,5	376 500,6	2 744,86	379 245,46	-120 747,04	0,58%	0,53%
XS2344735811	ENIIM 0.375% 06/28 EMTN	EUR	1 500 000	99,855	82,567	1 497 825	1 238 498,94	3 128,42	1 241 627,36	-256 197,64	1,90%	1,73%
XS2344772426	HMSOLN 1.75% 06/27	EUR	1 500 000	100,335	78,409	1 505 025	1 176 128,6	15 390,41	1 191 519,01	-313 505,99	1,82%	1,66%
XS2348325494	TENN 0.5% 06/31 EMTN	EUR	500 000	100,95	75,579	504 750	377 895,63	1 424,66	379 320,29	-125 429,71	0,58%	0,53%
XS2353182020	ENELIM 0% 06/27 EMTN	EUR	1 700 000	98,909	84,577	1 681 453	1 437 807,2	0	1 437 807,2	-243 645,8	2,20%	2,00%
XS2465984529	MIZUHO 2.096% 04/32 EMTN	EUR	700 000	93,33	83,392	653 310	583 742,1	10 853,26	594 595,36	-58 714,64	0,91%	0,83%
XS2466350993	TD 1.952% 04/30 EMTN	EUR	1 000 000	95,244	86,21	952 440	862 097,72	14 439,45	876 537,17	-75 902,83	1,34%	1,22%

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						77 421 017,22	64 882 438,86		65 496 356,22	-11 924 661	100,00%	91,21%
Obligation Taux Fixe						54 748 030,71	45 677 791,79		46 006 853,79	-8 741 176,92	70,24%	64,07%
SECTEUR PRIVE CORPORATE DETTE SENIOR						7 425 181,21	6 469 631,61		6 501 062,47	-924 118,74	9,93%	9,05%
DE000A2GSCX1	DAIGR 2.125% 03/07/37	EUR	300 000	114,422	81,85	343 266	245 549,93	3 213,7	248 763,63	-94 502,37	0,38%	0,35%
FR0013495181	BNFP 0.571% 03/27 EMTN	EUR	1 000 000	104,671	89,724	1 046 705	897 240,98	4 568	901 808,98	-144 896,02	1,38%	1,26%
FR0013512969	HOFP 1% 05/28 EMTN	EUR	1 000 000	104,073	86,549	1 040 730,52	865 492,59	6 383,56	871 876,15	-168 854,37	1,33%	1,21%
XS1963744260	MCD 0.9% 06/26 EMTN	EUR	1 000 000	103,71	91,67	1 037 100	916 696,74	4 980,82	921 677,56	-115 422,44	1,41%	1,28%
XS2020608548	HERIM 0.875% 07/27 EMTN	EUR	1 167 000	98,407	87,859	1 148 409,69	1 025 314,88	5 091,64	1 030 406,52	-118 003,17	1,57%	1,43%
XS2025466413	ABESM 0.625% 07/25 EMTN	EUR	800 000	99,09	91,705	792 720	733 636,8	2 356,16	735 992,96	-56 727,04	1,12%	1,02%
XS2082324018	MTNA 1.75% 11/25 EMTN	EUR	1 000 000	101,72	94,331	1 017 200	943 306,9	2 157,53	945 464,43	-71 735,57	1,44%	1,32%
XS2115091717	IBM 0.3% 02/28	EUR	1 000 000	99,905	84,239	999 050	842 392,79	2 679,45	845 072,24	-153 977,76	1,29%	1,18%
SECTEUR PRIVE FINANCIER DETTE SENIOR						8 445 554	7 426 735,41		7 478 595,69	-966 958,31	11,42%	10,41%
FR0013433596	FRLBP 0.25% 07/26 EMTN	EUR	1 000 000	99,765	88,791	997 650	887 912,06	1 198,63	889 110,69	-108 539,31	1,36%	1,24%
FR0013479276	SOCGEN 0.75% 01/27 EMTN	EUR	1 000 000	101,306	86,552	1 013 064	865 521,17	7 047,95	872 569,12	-140 494,88	1,33%	1,22%
XS1376614118	ULFP 1.375% 09/03/26	EUR	1 000 000	106,766	91,054	1 067 660	910 542,21	11 301,37	921 843,58	-145 816,42	1,41%	1,28%
XS1538284230	ACAAP 1.875% 12/26	EUR	1 000 000	110,637	92,168	1 106 370	921 678,55	719,18	922 397,73	-183 972,27	1,41%	1,28%
XS1751004232	SANTAN 1.125% 01/25 EMTN	EUR	1 000 000	104,01	95,14	1 040 100	951 397,91	10 818,49	962 216,4	-77 883,6	1,47%	1,34%
XS1941841311	ASSGEN 3.875% 01/29 EMTN	EUR	200 000	100	95,531	200 000	191 061,3	7 197,95	198 259,25	-1 740,75	0,30%	0,28%
XS2013574038	CABKSM 1.375% 06/26 EMTN	EUR	1 000 000	99,412	90,625	994 120	906 245,01	7 458,9	913 703,91	-80 416,09	1,40%	1,27%
XS2013745703	BANCO BILBAO VIZCAYA 1.00%	EUR	1 000 000	102,88	91,246	1 028 800	912 463,47	5 369,86	917 833,33	-110 966,67	1,40%	1,28%
XS2063247915	SANTAN 0.3% 10/26 EMTN	EUR	1 000 000	99,779	87,991	997 790	879 913,73	747,95	880 661,68	-117 128,32	1,34%	1,23%
SECTEUR PRIVE FINANCIER DETTE SUBORDONNE						531 250	491 247,01		493 774,18	-37 475,82	0,75%	0,69%
FR0012395689	ACAAP 3% 2/25	EUR	500 000	106,25	98,249	531 250	491 247,01	2 527,17	493 774,18	-37 475,82	0,75%	0,69%
Obligation Taux Variable						22 672 986,51	19 204 647,07		19 489 502,43	-3 183 484,08	29,76%	27,14%
-						11 241 200	8 976 372,93		9 109 030,22	-2 132 169,78	13,91%	12,69%
FR0013067196	SCOR 3% 06/46	EUR	1 000 000	112,001	92,013	1 120 010	920 130,31	17 178,08	937 308,39	-182 701,61	1,43%	1,31%
FR0013532280	BNP VAR 09/28	EUR	1 000 000	99,296	83,2	992 960	832 000,67	1 698,63	833 699,3	-159 260,7	1,27%	1,16%
FR0014002X43	BNP VAR 04/27 EMTN	EUR	1 000 000	99,407	87,281	994 070	872 811,38	1 815,07	874 626,45	-119 443,55	1,34%	1,22%
FR0014007LK5	BNP VAR 07/30 EMTN	EUR	1 000 000	94,518	79,429	945 180	794 287,91	4 219,18	798 507,09	-146 672,91	1,22%	1,11%
XS1346228577	AXASA 3.375% 06/07/47	EUR	1 000 000	115,505	92,478	1 155 050	924 782	16 736,3	941 518,3	-213 531,7	1,44%	1,31%
XS1508392625	ALATPF VAR PERP(3.75%)	EUR	1 000 000	103,25	50,576	1 032 500	505 763,66	35 753,42	541 517,08	-490 982,92	0,83%	0,75%
XS1716927766	FERSM VAR PERP	EUR	1 000 000	100	79,905	1 000 000	799 052,07	13 616,88	812 668,95	-187 331,05	1,24%	1,13%
XS2290960520	TTEFP VAR PERP NC7	EUR	1 000 000	100	81,516	1 000 000	815 156,3	15 270,55	830 426,85	-169 573,15	1,27%	1,16%
XS2295335413	IBESM VAR PERP NC6	EUR	1 000 000	101,02	85,049	1 010 200	850 494,86	13 030,14	863 525	-146 675	1,32%	1,20%
XS2297549391	CABKSM VAR 02/29 EMTN	EUR	1 000 000	99,514	81,021	995 140	810 212,55	4 493,15	814 705,7	-180 434,3	1,24%	1,13%

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						77 421 017,22	64 882 438,86		65 496 356,22	-11 924 661	100,00%	91,21%
Obligation Taux Variable						22 672 986,51	19 204 647,07		19 489 502,43	-3 183 484,08	29,76%	27,14%
-						11 241 200	8 976 372,93		9 109 030,22	-2 132 169,78	13,91%	12,69%
XS2321466133	BACR VAR 03/31 EMTN	EUR	1 000 000	99,609	85,168	996 090	851 681,22	8 845,89	860 527,11	-135 562,89	1,31%	1,20%
OBLIGATIONS INDEXEES ET PARTICIPANTES						7 660 187	6 810 504,28		6 923 793,67	-736 393,33	10,57%	9,64%
FR0011942283	ENGIFP VAR PERP(3.875%)	EUR	600 000	113,23	99,371	679 380	596 226,87	13 695,21	609 922,08	-69 457,92	0,93%	0,85%
FR0013330529	ULFP VAR PERP	EUR	1 000 000	99,625	85,602	996 250	856 024,95	4 075,34	860 100,29	-136 149,71	1,31%	1,20%
FR0013367612	EDF VAR PERP	EUR	1 000 000	108,5	94,073	1 085 000	940 726,06	9 972,6	950 698,66	-134 301,34	1,45%	1,32%
XS0856556807	HANRUE FRN 6/43	EUR	1 000 000	120,66	100,322	1 206 600	1 003 220,98	25 616,44	1 028 837,42	-177 762,58	1,57%	1,43%
XS0878743623	AXASA FRN 7/43	EUR	500 000	120,18	100,629	600 900	503 144,13	12 847,6	515 991,73	-84 908,27	0,79%	0,72%
XS1974787480	TTEFP VAR PERP EMTN	EUR	1 800 000	100	94,658	1 800 000	1 703 839,26	23 646,58	1 727 485,84	-72 514,16	2,64%	2,41%
XS2069101868	KONINKLIJKE KPN NV 2.50% 01	EUR	1 300 000	99,389	92,871	1 292 057	1 207 322,03	23 435,62	1 230 757,65	-61 299,35	1,88%	1,71%
SECTEUR PRIVE FINANCIER DETTE SENIOR						1 025 040	923 877,16		926 524,39	-98 515,61	1,41%	1,29%
XS1706111793	MS 1.342% 23/10/26	EUR	1 000 000	102,504	92,388	1 025 040	923 877,16	2 647,23	926 524,39	-98 515,61	1,41%	1,29%
SECTEUR PRIVE FINANCIER DETTE SUBORDONNE						2 746 559,51	2 493 892,7		2 530 154,15	-216 405,36	3,86%	3,52%
XS1788982996	LLOYDS VAR 09/28 EMTN	EUR	1 000 000	99,819	96,201	998 187,01	962 007,95	5 657,53	967 665,48	-30 521,53	1,48%	1,35%
XS2055089457	UCGIM VAR 09/29 EMTN	EUR	750 000	99,783	91,886	748 372,5	689 147,15	4 191,78	693 338,93	-55 033,57	1,06%	0,97%
XS2101558307	UCGIM VAR 01/32	EUR	1 000 000	100	84,274	1 000 000	842 737,6	26 412,14	869 149,74	-130 850,26	1,33%	1,21%
Total						83 658 123,34	71 195 402,08	613 917,36	71 809 319,44	-11 848 803,9		