



SIENNA CREDIT 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	43 326		43 326	43 326	100,00%	0,07%
Future sur obligation						0	43 326		43 326	43 326	100,00%	0,07%
-						0	43 326		43 326	43 326	100,00%	0,07%
FBOL0000011J	EURO BUND 0324	EUR	17	135,316	137,22	0	32 370	0	32 370	32 370	74,71%	0,05%
FBOL0000011M	EURO BTP 0324	EUR	-30	115,894	119,15	0	-97 670	0	-97 670	-97 670	-225,43%	-0,15%
FBOL00000120	EURO BOBL 0324	EUR	45	117,624	119,28	0	74 500	0	74 500	74 500	171,95%	0,12%
FBOL00000122	EURO SCHATZ 0324	EUR	50	105,862	106,545	0	34 126	0	34 126	34 126	78,77%	0,05%
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	-2 300 370				0		0	0	0,00%	0,00%
OFSFBOL0000011M	EURO BTP 0324 OFFSET	EUR	3 476 830				0		0	0	0,00%	0,00%
OFSFBOL00000120	EURO BOBL 0324 OFFSET	EUR	-5 293 100				0		0	0	0,00%	0,00%
OFSFBOL00000122	EURO SCHATZ 0324 OFFSET	EUR	-5 293 124				0		0	0	0,00%	0,00%
Monétaire & Liquidité						7 478 841,88	7 652 404,58		7 652 404,58	173 562,7	100,00%	11,95%
Devise						1 441 156,41	1 449 004,24		1 449 004,24	7 847,83	18,94%	2,26%
-						1 441 156,41	1 449 004,24		1 449 004,24	7 847,83	18,94%	2,26%
CASH EUR	Euro	EUR	1 449 004,24	1	1	1 441 156,41	1 449 004,24	0	1 449 004,24	7 847,83	18,94%	2,26%
OPCVM Monétaire						6 037 685,47	6 203 400,34		6 203 400,34	165 714,87	81,06%	9,68%
-						3 999 999,72	4 152 544,3		4 152 544,3	152 544,58	54,26%	6,48%
FR001400EBN2	SIENNA TRES PLUS PART A	EUR	3 988,348	1 002,921	1 041,169	3 999 999,72	4 152 544,3	0	4 152 544,3	152 544,58	54,26%	6,48%
OPCVM COURT TERME						2 037 685,75	2 050 856,04		2 050 856,04	13 170,29	26,80%	3,20%
FR0007081278	SIENNA MONETAIRE ISR A	EUR	16 933	120,338	121,116	2 037 685,75	2 050 856,04	0	2 050 856,04	13 170,29	26,80%	3,20%
Obligation						57 242 852,86	55 851 551,1		56 359 462,46	-883 390,4	100,00%	87,99%
Obligation Taux Fixe						42 606 528,86	41 599 013,08		41 939 765,27	-666 763,59	74,41%	65,47%
-						36 435 468,6	35 636 725,09		35 948 412,65	-487 055,95	63,78%	56,12%
CH0595205524	UBS 0.25% 02/28	EUR	1 000 000	99,461	88,057	994 610	880 569,34	2 143,84	882 713,18	-111 896,82	1,57%	1,38%
DE000A351ZR8	DBOERS 3.875% 09/26	EUR	500 000	99,839	102,219	499 195	511 094,32	5 134,9	516 229,22	17 034,22	0,92%	0,81%
DE000A351ZT4	DBOERS 3.875% 09/33	EUR	1 000 000	98,769	106,524	987 690	1 065 242,42	10 269,81	1 075 512,23	87 822,23	1,91%	1,68%
FR0011991488	RTE 2.75% 6/29	EUR	1 000 000	94,82	98,913	948 200	989 133,92	14 801,91	1 003 935,83	55 735,83	1,78%	1,57%
FR0013283140	SEVFP 1.625% 09/32	EUR	1 000 000	103,104	88,904	1 031 040	889 037,17	4 617,49	893 654,66	-137 385,34	1,59%	1,40%
FR0013299641	BNP 1% 11/24 EMTN	EUR	500 000	96,1	97,18	480 500	485 900,32	478,14	486 378,46	5 878,46	0,86%	0,76%
FR0013425139	PUBFP 0.625% 06/25	EUR	1 000 000	95,435	95,892	954 350	958 924,62	3 483,61	962 408,23	8 058,23	1,71%	1,50%
FR0013509627	DECFP 2% 10/24	EUR	1 000 000	98,04	98,442	980 400	984 420,78	3 879,78	988 300,56	7 900,56	1,75%	1,54%
FR0014000UC8	URWFP 0.625% 05/27 EMTN	EUR	500 000	99,239	91,524	496 195	457 619,26	2 083,33	459 702,59	-36 492,41	0,82%	0,72%
FR0014001I50	VIEFP % 01/27 EMTN	EUR	1 000 000	100,126	91,521	1 001 260	915 207,69	0	915 207,69	-86 052,31	1,62%	1,43%
FR00140044X1	FRLBP 0.75% 06/31 EMTN	EUR	1 000 000	99,598	82,214	995 980	822 141,06	3 975,41	826 116,47	-169 863,53	1,47%	1,29%
FR0014007NF1	ICADFP 1% 01/30	EUR	500 000	95,18	85,166	475 900	425 830,53	4 780,82	430 611,35	-45 288,65	0,76%	0,67%
FR001400CH94	DGFP 2.75% 09/32 EMTN	EUR	1 500 000	90,231	97,207	1 353 465	1 458 103,05	13 862,7	1 471 965,75	118 500,75	2,61%	2,30%

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						57 242 852,86	55 851 551,1		56 359 462,46	-883 390,4	100,00%	87,99%
Obligation Taux Fixe						42 606 528,86	41 599 013,08		41 939 765,27	-666 763,59	74,41%	65,47%
-						36 435 468,6	35 636 725,09		35 948 412,65	-487 055,95	63,78%	56,12%
FR001400KMK2	ORAFP 3.875% 09/35 EMTN	EUR	400 000	99,906	106,577	399 624	426 306,88	4 827,87	431 134,75	31 510,75	0,76%	0,67%
FR001400KL23	PRAEFP 5.5% 09/28	EUR	500 000	100,078	104,821	500 391,6	524 106,21	7 964,48	532 070,69	31 679,09	0,94%	0,83%
FR001400KR43	AGFRNC 3.75% 09/38 EMTN	EUR	500 000	99,033	106,872	495 165	534 361,44	5 379,1	539 740,54	44 575,54	0,96%	0,84%
FR001400L263	HOFPP 4.25% 10/31 EMTN	EUR	500 000	99,67	106,315	498 350	531 572,78	4 470,63	536 043,41	37 693,41	0,95%	0,84%
FR001400LCK1	VPARKI 4.5% 04/30	EUR	700 000	98,769	104,056	691 383	728 389,66	6 627,05	735 016,71	43 633,71	1,30%	1,15%
FR001400LWN3	BFCM 4.75% 11/31 EMTN	EUR	500 000	99,564	106,239	497 820	531 194,73	3 504,1	534 698,83	36 878,83	0,95%	0,83%
FR001400M8W6	COFCHD 5.75% 11/33	EUR	600 000	99,212	103,871	595 270	623 223,44	3 393,44	626 616,88	31 346,88	1,11%	0,98%
FR001400M9L7	EDF 3.75% 06/27 EMTN	EUR	400 000	99,776	102,025	399 104	408 098,04	1 188,52	409 286,56	10 182,56	0,73%	0,64%
FR001400MLN4	URWFP 4.125% 12/30 EMTN	EUR	500 000	99,95	103,083	499 750	515 417,49	1 296,11	516 713,6	16 963,6	0,92%	0,81%
XS1197833137	KO 1.625% 3/35	EUR	500 000	111,899	86,669	559 495	433 345,35	6 659,84	440 005,19	-119 489,81	0,78%	0,69%
XS1200679667	BRK 1.625% 3/35	EUR	500 000	79,955	84,642	399 775	423 209,13	6 504,44	429 713,57	29 938,57	0,76%	0,67%
XS1379122101	AMXLMM 1.5% 10/03/24	EUR	1 000 000	99,384	99,481	993 840	994 807,33	12 254,1	1 007 061,43	13 221,43	1,79%	1,57%
XS1955187932	SIEGR 1.75% 02/39 EMTN	EUR	200 000	103,945	83,128	207 890	166 256,05	2 963,01	169 219,06	-38 670,94	0,30%	0,26%
XS1960678412	MDT 1.625% 03/31	EUR	500 000	110,34	90,742	551 700	453 708,6	6 704,23	460 412,83	-91 287,17	0,82%	0,72%
XS2051362312	AT&T 1.8% 09/39	EUR	500 000	98,625	76,371	493 125	381 857,36	2 729,51	384 586,87	-108 538,13	0,68%	0,60%
XS2152796269	AIRFP 2% 04/28	EUR	1 325 000	104,479	96,735	1 384 345,5	1 281 738,18	19 621,58	1 301 359,76	-82 985,74	2,31%	2,03%
XS2198582301	TACHEM 2% 07/40	EUR	500 000	107,437	79,631	537 185	398 154,15	4 863,39	403 017,54	-134 167,46	0,72%	0,63%
XS2305244241	LPTY 0.25% 02/26 EMTN	EUR	1 000 000	99,614	93,224	996 140	932 244,61	2 150,68	934 395,29	-61 744,71	1,66%	1,46%
XS2320759538	VZ 0.375% 03/29	EUR	1 000 000	99,67	87,042	996 700	870 424,69	2 940,57	873 365,26	-123 334,74	1,55%	1,36%
XS2337252931	FDX 0.45% 05/29	EUR	500 000	99,684	87,028	498 420	435 142,03	1 500	436 642,03	-61 777,97	0,77%	0,68%
XS2343114687	ERFFP 0.875% 05/31	EUR	500 000	99,999	81,451	499 992,5	407 256,34	2 737,36	409 993,7	-89 998,8	0,73%	0,64%
XS2344735811	ENIIM 0.375% 06/28 EMTN	EUR	500 000	99,855	89,166	499 275	445 829,65	1 039,96	446 869,61	-52 405,39	0,79%	0,70%
XS2348325494	TENN 0.5% 06/31 EMTN	EUR	500 000	100,95	89,448	504 750	447 238,33	1 420,77	448 659,1	-56 090,9	0,80%	0,70%
XS2397077426	CBAAU 0.125% 10/29	EUR	1 000 000	82,112	85,255	821 120	852 550,89	273,22	852 824,11	31 704,11	1,51%	1,33%
XS2466350993	TD 1.952% 04/30 EMTN	EUR	1 000 000	95,244	91,915	952 440	919 149,54	14 400	933 549,54	-18 890,46	1,66%	1,46%
XS2551280436	SVENSKA HANDELSBANKEN 3.75% 22-01/11/2	EUR	1 000 000	99,683	102,675	996 830	1 026 749,62	6 454,92	1 033 204,54	36 374,54	1,83%	1,61%
XS2577127884	ANZ 3.652% 01/26 EMTN	EUR	500 000	99,09	100,825	495 450	504 122,82	17 409,53	521 532,35	26 082,35	0,93%	0,81%
XS2617442525	VW 4.25% 01/26 EMTN	EUR	500 000	99,26	101,246	496 300	506 230,09	14 263,7	520 493,79	24 193,79	0,92%	0,81%
XS2629064267	STERV 4.25% 09/29 EMTN	EUR	600 000	98,42	102,693	590 520	616 155,96	8 639,34	624 795,3	34 275,3	1,11%	0,98%
XS2657613720	HNDA 3.75% 10/27	EUR	1 000 000	98,889	102,682	988 890	1 026 822,5	7 172,13	1 033 994,63	45 104,63	1,83%	1,61%
XS2676814499	CABKSM 4.25% 09/30 EMTN	EUR	1 500 000	99,572	103,965	1 493 580	1 559 472,85	20 727,46	1 580 200,31	86 620,31	2,80%	2,47%
XS2676863355	PHIANA 4.25% 09/31 EMTN	EUR	1 000 000	99,741	102,558	997 410	1 025 583,7	13 586,07	1 039 169,77	41 759,77	1,84%	1,62%
XS2680945479	FERR SE 4.375 09-30	EUR	800 000	99,587	105,591	796 696	844 726,69	10 710,38	855 437,07	58 741,07	1,52%	1,34%
XS2705604234	SANTAN 4.875% 10/31 EMTN	EUR	500 000	99,42	106,629	497 100	533 143	5 128,07	538 271,07	41 171,07	0,96%	0,84%
XS2720896047	LEASYS 4.625 02-27	EUR	1 000 000	101,091	102,649	1 010 911	1 026 490,44	6 082,19	1 032 572,63	21 661,63	1,83%	1,61%

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						57 242 852,86	55 851 551,1		56 359 462,46	-883 390,4	100,00%	87,99%
Obligation Taux Fixe						42 606 528,86	41 599 013,08		41 939 765,27	-666 763,59	74,41%	65,47%
-						36 435 468,6	35 636 725,09		35 948 412,65	-487 055,95	63,78%	56,12%
XS2723549528	SGOFP 3.75% 11/26 EMTN	EUR	400 000	99,883	101,708	399 532	406 831,6	1 434,43	408 266,03	8 734,03	0,72%	0,64%
XS2726256113	CABKSM 4.375% 11/33 EMTN	EUR	200 000	99,113	105,218	198 226	210 436,84	836,75	211 273,59	13 047,59	0,37%	0,33%
XS2726335099	ROSW 3.586% 12/36	EUR	600 000	100,471	105,904	602 826	635 421,27	1 763,61	637 184,88	34 358,88	1,13%	0,99%
XS2731506841	MET 3.75% 12/31 GMTN	EUR	200 000	99,681	102,865	199 362	205 730,33	553,28	206 283,61	6 921,61	0,37%	0,32%
SECTEUR PRIVE CORPORATE DETTE SENIOR						4 257 310,26	4 089 780,91		4 113 367,39	-143 942,87	7,30%	6,42%
FR0013512969	HOPF 1% 05/28 EMTN	EUR	500 000	104,073	91,716	520 365,26	458 582,17	3 183,06	461 765,23	-58 600,03	0,82%	0,72%
XS1292384960	AAPL 1.375% 01/24	EUR	1 000 000	99,81	99,899	998 100	998 990,73	13 222,6	1 012 213,33	14 113,33	1,80%	1,58%
XS2025466413	ABESM 0.625% 07/25 EMTN	EUR	800 000	99,09	95,828	792 720	766 626,45	2 349,73	768 976,18	-23 743,82	1,36%	1,20%
XS2082324018	MTNA 1.75% 11/25 EMTN	EUR	1 000 000	101,72	96,373	1 017 200	963 727,63	2 151,64	965 879,27	-51 320,73	1,71%	1,51%
XS2115091717	IBM 0.3% 02/28	EUR	1 000 000	92,892	90,185	928 925	901 853,93	2 679,45	904 533,38	-24 391,62	1,60%	1,41%
SECTEUR PRIVE FINANCIER DETTE SENIOR						1 913 750	1 872 507,08		1 877 985,23	-35 764,77	3,33%	2,93%
FR0013412947	BFCM 0.75% 06/26 EMTN	EUR	1 000 000	91,61	94,177	916 100	941 765,81	4 282,79	946 048,6	29 948,6	1,68%	1,48%
FR0013433596	FRLBP 0.25% 07/26 EMTN	EUR	1 000 000	99,765	93,074	997 650	930 741,27	1 195,36	931 936,63	-65 713,37	1,65%	1,45%
Obligation Taux Variable						14 636 324	14 252 538,02		14 419 697,19	-216 626,81	25,59%	22,51%
-						11 563 884	11 293 952,49		11 422 131,38	-141 752,62	20,27%	17,83%
DE000A3LNY11	MBGGR FRN 09/25 EMTN	EUR	1 000 000	99,85	100,005	998 500	1 000 050,04	572,92	1 000 622,96	2 122,96	1,78%	1,56%
FR0013067196	SCOR 3% 06/46	EUR	1 000 000	112,001	97,363	1 120 010	973 630,45	17 131,15	990 761,6	-129 248,4	1,76%	1,55%
FR0013516184	ACAFV VAR 06/30 EMTN	EUR	1 000 000	93,951	96,69	939 510	966 900,38	9 412,57	976 312,95	36 802,95	1,73%	1,52%
FR0014002X43	BNP VAR 04/27 EMTN	EUR	1 000 000	99,407	92,847	994 070	928 472,53	1 810,11	930 282,64	-63 787,36	1,65%	1,45%
FR001400KZQ1	SOCGEN VAR 09/29	EUR	800 000	99,483	104,311	795 864	834 484,87	10 071,04	844 555,91	48 691,91	1,50%	1,32%
FR001400L4Y2	ALD FLR 10-25	EUR	700 000	100	100,232	700 000	701 620,93	7 981,32	709 602,25	9 602,25	1,26%	1,11%
FR001400M1X9	SOGESA VAR 05/44	EUR	200 000	99,664	108,124	199 328	216 248,62	1 704,92	217 953,54	18 625,54	0,39%	0,34%
XS1083986718	AVLN VAR 7/44(3.875%)	EUR	1 000 000	99,12	99,181	991 200	991 810	19 480,87	1 011 290,87	20 090,87	1,79%	1,58%
XS1346228577	AXASA 3.375% 06/07/47	EUR	1 000 000	115,505	98,066	1 155 050	980 655,69	16 690,57	997 346,26	-157 703,74	1,77%	1,56%
XS2080205367	NWG VAR 11/25	EUR	500 000	96,25	97,262	481 250	486 310,26	502,05	486 812,31	5 562,31	0,86%	0,76%
XS2200150766	CABKSM VAR 07/26 EMTN	EUR	500 000	94,86	96,134	474 300	480 669,15	1 813,52	482 482,67	8 182,67	0,86%	0,75%
XS2321466133	BACR VAR 03/31 EMTN	EUR	500 000	99,609	92,258	498 045	461 289,15	4 410,86	465 700,01	-32 344,99	0,83%	0,73%
XS2360310044	UCGIM VAR 07/29 EMTN	EUR	500 000	84,459	89,022	422 295	445 110,5	1 989,07	447 099,57	24 804,57	0,79%	0,70%
XS2620201421	BBVASM VAR 05/26 GMTN	EUR	1 000 000	99,692	100,664	996 918	1 006 640,16	26 823,77	1 033 463,93	36 545,93	1,83%	1,61%
XS2705604077	SANTAN VAR 10/27 EMTN	EUR	800 000	99,693	102,507	797 544	820 059,76	7 784,15	827 843,91	30 299,91	1,47%	1,29%
OBLIGATIONS INDEXEES ET PARTICIPANTES						2 578 890	2 462 935,2		2 497 458,51	-81 431,49	4,43%	3,90%
FR0013367612	EDF VAR PERP	EUR	1 000 000	108,5	99,367	1 085 000	993 672,25	9 945,36	1 003 617,61	-81 382,39	1,78%	1,57%
XS1974787480	TTEFP VAR PERP EMTN	EUR	500 000	100	99,179	500 000	495 896,62	6 550,55	502 447,17	2 447,17	0,89%	0,78%
XS2069101868	KONINKLIJKE KPN NV 2.50% 01/02/99 EUR	EUR	1 000 000	99,389	97,337	993 890	973 366,33	18 027,4	991 393,73	-2 496,27	1,76%	1,55%

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						57 242 852,86	55 851 551,1		56 359 462,46	-883 390,4	100,00%	87,99%
Obligation Taux Variable						14 636 324	14 252 538,02		14 419 697,19	-216 626,81	25,59%	22,51%
SECTEUR PRIVE FINANCIER DETTE SENIOR						493 550	495 650,33		500 107,3	6 557,3	0,89%	0,78%
CH0409606354	UBS VAR 04/25	EUR	500 000	98,71	99,13	493 550	495 650,33	4 456,97	500 107,3	6 557,3	0,89%	0,78%
Total						64 721 694,74	63 547 281,68	507 911,36	64 055 193,04	-666 501,7		