

AMILTON STRATEGIC INCOME

DOCUMENT D'INFORMATION PÉRIODIQUE AU 31/01/2022

ETAT DU PATRIMOINE EN EUR

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier	15 184 854,12
b) Avoirs bancaires	516 670,70
c) Autres actifs détenus par l'OPC	1 979 870,57
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	17 681 395,39
e) Passif	-504 036,35
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	17 177 359,04

* Les montants sont signés

NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
AMILTON STRATEGIC INCOME Part D	D	16 481,38	159,2475	103,49
AMILTON STRATEGIC INCOME Part I	C	15 273 039,70	1 483,5241	10 295,10
AMILTON STRATEGIC INCOME Part R	C	1 887 837,96	18 280,1725	103,27

ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Éléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	82,40	80,05
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	6,01	5,83
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	9,08	8,82

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Euro	EUR	15 184 854,12	88,40	85,88
TOTAL		15 184 854,12	88,40	85,88

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR

Pays	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
FRANCE	35,46	34,45
ALLEMAGNE	15,95	15,49
ITALIE	8,90	8,64
LUXEMBOURG	7,82	7,60
ETATS-UNIS	4,83	4,69
IRLANDE	4,69	4,56
PAYS-BAS	4,19	4,07
ESPAGNE	2,95	2,87
PORTUGAL	2,43	2,36
ROYAUME-UNI	1,18	1,14
TOTAL	88,40	85,88

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

RÉPARTITION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE

Nature d'actifs	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Organismes de placement collectif		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	8,07	7,84
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE	0,00	0,00
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés	1,01	0,98
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés	0,00	0,00
Autres organismes non européens	0,00	0,00
Autres actifs		
Autres	0,00	0,00
TOTAL	9,08	8,82

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

Eléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	5 395 061,65	2 904 700,58
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	316 168,67	0,00
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	644 783,24	431 031,55

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt (1) EUR	Montant brut unitaire (2) EUR
Dividendes versés			
Dividendes à verser			
AMILTON STRATEGIC INCOME Part D			

(1) Le crédit d'impôt unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

(2) Le montant brut unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

INFORMATION SUR LES FRAIS DE GESTION VARIABLES

	31/01/2022
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	8,02
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	1,08
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00

« Le montant des frais de gestion variables affiché ci-dessus correspond à la somme des provisions et reprises de provisions ayant impacté l'actif net au cours de la période sous revue .»

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/01/2022 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
BUND DEUT ZCP 15-08-26	EUR	1 200 000	1 217 106,00	7,09
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND ZCP 15-12-23	EUR	500 000	505 040,00	2,94
BUNDSOBLIGATION 0.0% 05-04-24	EUR	800 000	809 604,00	4,71
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 1.5% 01-10-24	EUR	200 000	207 250,18	1,21
TOTAL ALLEMAGNE			2 739 000,18	15,95
ESPAGNE				
AMADEUS CM E3R+0.45% 18-03-22	EUR	300 000	300 169,50	1,74
CELL 2.375% 16-01-24 EMTN	EUR	200 000	207 268,22	1,21
TOTAL ESPAGNE			507 437,72	2,95
ETATS-UNIS				
BALL 4.375% 15-12-23	EUR	200 000	214 685,48	1,25
GENE MOT 0.955% 07-09-23 EMTN	EUR	100 000	101 800,23	0,60
GENERAL MOTORS FINANCIAL 0.65% 07-09-28	EUR	100 000	95 776,56	0,55
MMS USA FINANCING 0.625% 13-06-25	EUR	200 000	201 722,37	1,18
NETFLIX 3.0% 15-06-25	EUR	200 000	215 266,33	1,25
TOTAL ETATS-UNIS			829 250,97	4,83
FRANCE				
ACCOR 2.375% 29-11-28	EUR	200 000	200 314,89	1,17
ACCOR 2.5% 25-01-24	EUR	100 000	103 990,79	0,60
AIRBUS GROUP SE 1.375% 09-06-26	EUR	400 000	417 992,30	2,43
ALD 0.375% 19-10-23 EMTN	EUR	300 000	302 242,21	1,76
ARVAL SERVICE LEASE 0.0% 01-10-25	EUR	200 000	196 863,00	1,15
BPCE 0.625% 26-09-24 EMTN	EUR	300 000	304 271,67	1,77
BURE VERI 1.25% 07-09-23	EUR	400 000	408 415,40	2,38
CNP ASSURANCES 1.875% 20-10-22	EUR	100 000	101 853,38	0,60
COVIVIO SA 1.625% 17-10-24	EUR	100 000	104 158,32	0,61
CROWN EU HLD 2.25% 01-02-23	EUR	200 000	201 816,50	1,17
ELIS EX HOLDELIS 1.75% 11-04-24	EUR	200 000	206 141,95	1,20
FAURECIA 2.75% 15-02-27	EUR	200 000	200 663,34	1,17
GROUPE EIFFAGE 1.625% 14-01-27	EUR	200 000	202 459,18	1,18
HOLDING D INFRASTRUCTURES DES METIERS 0.125% 16-09-25	EUR	100 000	98 397,10	0,57
ILIAD 0.75% 11-02-24	EUR	200 000	198 085,01	1,15
JCDECAUX 2.0% 24-10-24	EUR	200 000	209 067,85	1,21
LAGARDERE 1.625% 21-06-24	EUR	200 000	205 114,33	1,19
PSA BANQUE FRANCE 0.625% 21-06-24	EUR	300 000	303 910,46	1,77
RENA CRE 0.5% 15-09-23 EMTN	EUR	300 000	302 531,34	1,76
RENAULT 1.0% 08-03-23 EMTN	EUR	100 000	101 405,35	0,59
RENAULT 1.0% 18-04-24 EMTN	EUR	100 000	100 554,02	0,58
SEB 1.375% 16-06-25	EUR	400 000	410 772,82	2,39
SPIE 3.125% 22-03-24	EUR	200 000	211 564,08	1,24
SR TELEPERFORMANCE 1.5% 03-04-24	EUR	100 000	103 712,92	0,60
TELEPERFORMANCE	EUR	200 000	193 838,15	1,13

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/01/2022 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
UBISOFT ENTERTAINMENT SA	EUR	400 000	386 831,53	2,25
VALEO ELECTRONIQUE ET SYSTEMES DE L 0.625% 11-01-23	EUR	100 000	100 435,67	0,59
WENDEL 2.75% 02-10-24	EUR	200 000	214 138,42	1,25
TOTAL FRANCE			6 091 541,98	35,46
IRLANDE				
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 0.5% 13-09-24	EUR	400 000	403 384,08	2,35
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 0.5% 18-09-23	EUR	200 000	201 689,34	1,17
RYANAIR 0.875% 25-05-26 EMTN	EUR	200 000	201 109,01	1,18
TOTAL IRLANDE			806 182,43	4,70
ITALIE				
DAVIDE CAMPARI MILANO 1.25% 06-10-27	EUR	200 000	199 942,07	1,16
FERRARI NV 1.5% 27-05-25	EUR	100 000	103 928,51	0,60
FINMECCANICA 1.5% 07-06-24	EUR	331 000	337 890,76	1,97
ISPIM 2 1/8 08/30/23	EUR	300 000	313 037,16	1,82
PRYSMIAN 2.5% 11/04/22	EUR	100 000	102 438,25	0,59
TELECOM ITALIA 5.25% 10/02/22	EUR	350 000	368 465,76	2,15
TELE ITA 3.25% 16-01-23 EMTN	EUR	100 000	102 781,87	0,60
TOTAL ITALIE			1 528 484,38	8,89
LUXEMBOURG				
ARCELLOR MITTAL 2.25% 17-01-24	EUR	300 000	310 927,89	1,81
ARCELOR MITTAL 0.95% 17-01-23	EUR	100 000	100 766,14	0,59
CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE ZCP 01-04-24	EUR	200 000	199 215,00	1,16
HEIDELBERGCEMENT FINANCE LUXEMBOURG 2.5% 09-10-24	EUR	400 000	426 728,08	2,48
SIG COMBIBLOC PURCHASER 1.875% 18-06-23	EUR	300 000	305 958,50	1,78
TOTAL LUXEMBOURG			1 343 595,61	7,82
PAYS-BAS				
0.25% 07-09-26 EMTN	EUR	100 000	97 694,87	0,57
HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 0.625% 24-07-25	EUR	200 000	199 230,82	1,16
STELLANTIS NV 2.375% 14-04-23	EUR	100 000	104 833,01	0,61
STELLANTIS NV 3.375% 07-07-23	EUR	300 000	317 657,34	1,85
TOTAL PAYS-BAS			719 416,04	4,19
PORTUGAL				
GALP ENERGIA 2.0% 15-01-26	EUR	400 000	417 648,52	2,43
TOTAL PORTUGAL			417 648,52	2,43
ROYAUME-UNI				
F 1.134 02/10/22	EUR	200 000	202 296,29	1,18
TOTAL ROYAUME-UNI			202 296,29	1,18
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			15 184 854,12	88,40
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			15 184 854,12	88,40
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
AMILTON SHORT DURATION I	EUR	42	434 491,68	2,53
IXIOS FUNDS IXIOS GLOBAL MINING SICAV ACT S	USD	85	94 898,22	0,55
TOTAL FRANCE			529 389,90	3,08

PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/01/2022 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
LUXEMBOURG				
ALLIANZ GLOBAL INVESTORS FUND ALLIANZ CHINA A SHARES P EUR	EUR	65	115 022,70	0,67
BLACKROCK GLOBAL FUNDS CHINA BOND FUND I2 EUR ACC	EUR	19 400	352 886,00	2,05
LYXOR STX600 BASIC RSRCES	EUR	1 700	148 782,30	0,87
MUL-LYXOR MSCI RUSSIA UCITS ETF	EUR	5 000	240 450,00	1,40
TOTAL LUXEMBOURG			857 141,00	4,99
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			1 386 530,90	8,07
Fonds professionnels à vocation générale et équival. d'autres Etats membres UE et organismes de titrisation cotés				
LUXEMBOURG				
LYXOR HONG KONG HSI-DIST	EUR	6 700	172 846,60	1,01
TOTAL LUXEMBOURG			172 846,60	1,01
TOTAL Fonds professionnels à vocation générale et équival. d'autres Etats membres UE et organismes de titrisation cotés			172 846,60	1,01
TOTAL Organismes de placement collectif			1 559 377,50	9,08
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
CD CADUSD 0322	USD	8	-9 598,57	-0,06
EURO BOBL 0322	EUR	-9	16 920,00	0,10
EURO STOXX 50 0322	EUR	5	-2 075,00	-0,01
FGBL BUND 10A 0322	EUR	12	-63 720,00	-0,37
PE MXNUSD 0322	USD	16	2 818,91	0,02
US 10YR NOTE 0322	USD	-17	22 886,93	0,13
XEUR FOAT EUR 0322	EUR	-14	72 100,00	0,42
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			39 332,27	0,23
TOTAL Engagements à terme fermes			39 332,27	0,23
TOTAL Instrument financier à terme			39 332,27	0,23
Appel de marge				
APPEL MARGE CACEIS	USD	-18 056,23	-16 107,25	-0,09
APPEL MARGE CACEIS	EUR	-23 225	-23 225,00	-0,14
TOTAL Appel de marge			-39 332,25	-0,23
Créances			305 767,23	1,78
Dettes			-287 925,64	-1,68
Comptes financiers			415 285,81	2,42
Actif net			17 177 359,04	100,00

Parts AMILTON STRATEGIC INCOME Part D	EUR	159,2475	103,49
Parts AMILTON STRATEGIC INCOME Part I	EUR	1 483,5241	10 295,10
Parts AMILTON STRATEGIC INCOME Part R	EUR	18 280,1725	103,27