

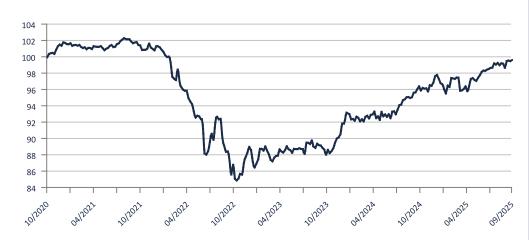
### SIENNA CREDIT R-C

Reporting au 30/09/2025

STRATÉGIE D'INVESTISSEMENT

Investi en obligations et autres titres de créances négociables, SIENNA CREDIT est composé de valeurs de la zone euro. L'objectif de gestion est d'atteindre la performance de son indicateur de référence, diminuée des frais de

### **ÉVOLUTION DE LA VL (BASE 100)**

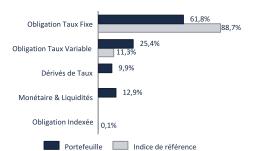


## PERFORMANCES DU FONDS

| Performances cumulées (en %)    | 1 mois | 2025 | 1 an | 3 ans  | 5 ans | <b>10</b> ans |
|---------------------------------|--------|------|------|--------|-------|---------------|
| Portefeuille                    | 0,48   | 3,07 | 3,67 | 16,37  | 0,06  | 11,89         |
| Indice de référence             | 0,39   | 2,74 | 3,62 | 17,66  | 1,81  | 19,80         |
| Performances annualisées (en %) |        |      | 1 an | 3 ans  | 5 ans | <b>10</b> ans |
| Portefeuille                    |        |      | 3,67 | 5,18   | 0,01  | 1,13          |
| Indice de référence             |        |      | 3,62 | 5,57   | 0,36  | 1,82          |
| Performances annuelles (en %)   |        | 2024 | 2023 | 2022   | 2021  | 2020          |
| Portefeuille                    |        | 3,76 | 7,83 | -14,24 | -0,82 | 1,79          |
| Indice de référence             |        | 4,69 | 8,18 | -13,69 | -0,78 | 2,97          |

Les performances passées ne présagent pas des performances futures. Les performances affichées sont nettes de frais de gestion et n'incluent pas les frais de souscription éventuels qui restent à la charge du souscripteur. Cés frais de souscription ne sont pas acquis par la société de gestion et sont versés au distributeur.

#### ALLOCATION D'ACTIFS DU PORTEFEUILLE



# LES PRINCIPALES LIGNES HORS OPC

| Valeurs                | Poids |
|------------------------|-------|
| ENIIM VAR PERP EMTN    | 1,86% |
| BFCM 3.375% 06/32 EMTN | 1,80% |
| FDJFP 3.375% 11/33     | 1,63% |
| ACFP 3.5% 03/33 EMTN   | 1,43% |
| TD 3.357% 09/32 GMTN   | 1,43% |

Actif net du portefeuille : 55,94 M€ Valeur liquidative de la part : 650,570 €

## **CARACTÉRISTIQUES**

Date de création : 31/12/1991 Durée de placement : > 5 ans Indicateur de risque (SRI) (1):



Forme juridique: FCP

Classification AMF: Obligations et autres titres de

créance libellés en euro

Code ISIN: FR0007392220

Devise: Euro Indice de référence :

Article SFDR (2): 8

(Coupons nets réinvestis) 100% Bloomberg Euro-Aggregate : Corporates --

Fréquence de valorisation : Quotidienne Société de gestion : SIENNA GESTION Gestionnaire: SIENNA GESTION

Valorisateur: CACEIS FUND ADMINISTRATION Frais de gestion et autres frais administratifs et

d'exploitation: 0,71%

Coûts de transaction: 0,44%

Affectation des resultats : Capitalisation

Principaux risques: Risque de perte en capital Risque de taux Risque de crédit Risque de durabilité Risque de contrepartie

(1) L'Indicateur synthétique de risque ou SRI (Synthetic Risk Indicator) est un indicateur du niveau de risque du produit combinant le risque de marché et le risque de crédit. Il est également disponible au sein du DIC PRIIPs. Le Règlement européen PRIIPs attribue à chaque produit un SRI unique de 1 à 7. Le niveau de risque faible ne signifie pas sans risque. Le capital investi n'est pas garanti : le fonds présente un risque de perte en capital.

(2) SFDR: Règlement 2019/2088 européen (Sustainable Finance Disclosure Regulation) sur la publication d'informations en matière de durabilité dans le secteur des services financiers. Il introduit de nouvelles obligations et normes communes de reporting pour les sociétés de gestion et les conseillers financiers afin de favoriser la transparence des produits financiers durables.

8 : Produit financier qui promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales.

## INDICATEURS DE RISQUE

| Volatilité annualisée       |  |  |  |  |
|-----------------------------|--|--|--|--|
| Portefeuille (en %)         |  |  |  |  |
| Indice de référence (en % ) |  |  |  |  |

| 1 an | 3 ans | 5 ans |
|------|-------|-------|
| 3,32 | 4,25  | 4,08  |
| 2.69 | 3.90  | 3.93  |

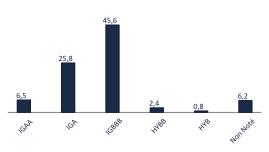


## **SENSIBILITÉ**

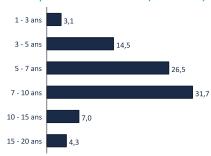
|                     | Date du rapport ivid | os precedent | 31/12/2024 |
|---------------------|----------------------|--------------|------------|
| Portefeuille        | 4,67                 | 5,15         | 5,25       |
| Indice de référence | 4,42                 | 4,40         | 4,35       |

### ANALYSE DU PORTEFEUILLE - TAUX

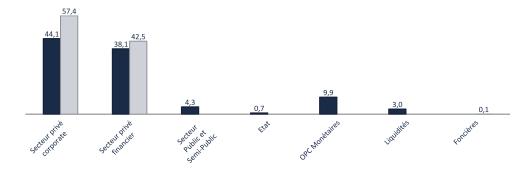
### Répartition par notation long terme (en % d'actif)



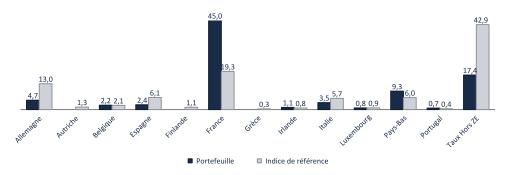
### Répartition par tranche de maturité (en % d'actif)



## Répartition par type d'émetteur (en % d'actif)



### Répartition géographique hors OPC (en % d'actif)



### ANALYSE EXTRA-FINANCIÈRE

#### **Note risque ESG**

|   | Portefeuille | Univers de départ |
|---|--------------|-------------------|
| Note risque ESG<br>moyenne pondérée     | 17,03        | 18,81             |
| Taux de couverture<br>(en % de l'actif) | 93,23%       | 93,23%            |

<u>Note risque ESG du portefeuille</u> : Évaluation des risques environnementaux, sociaux et de gouvernance (ESG) des émetteurs (0 absence de risques et 100 risque maximal). La note risque ESG des émetteurs est pondérée par le poids de l'actif de l'émetteur dans le portefeuille.

### Contribution des piliers E, S et G au risque ESG Global \*

| Fonds/Univers     | Contribution<br>du pilier E | Contribution<br>du pilier S | Contribution<br>du pilier G |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| Portefeuille      | 19,33%                      | 47,79%                      | 32,89%                      |
| Univers de départ | 18,45%                      | 49,03%                      | 32,51%                      |

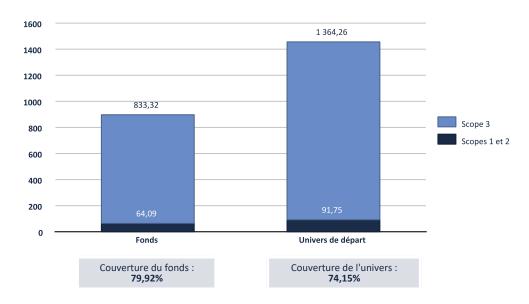
<sup>\*</sup> Les pourcentages présentés par pilier E ou S ou G représente la contribution de ce pilier au risque global ESG du fonds/univers. L'univers de départ pour ce fonds est : Bloomberg Euro Agg. Corpo&Fi.

#### Controverses par niveau de gravité

| Niveau de controverse         | % de l'actif du fonds (hors OPC,<br>dérivés,<br>liquidités, souverains)<br>exposé à des controverses | % de l'univers de départ exposé<br>à des controverses |
|-------------------------------|--|---|
| Aucune controverse identifiée | 15,74%   | 19,20%  |
| Niveau 1                      | 16,68%   | 15,50%  |
| Niveau 2                      | 41,12%   | 40,76%  |
| Niveau 3                      | 23,58%   | 20,03%  |
| Niveau 4                      | 2,87%  | 3,70%   |
| Niveau 5                      | 0,00%  | 0,81%   |
| Taux de couverture            | 93,24%   | 93,99%  |

#### ANALYSE EXTRA-FINANCIÈRE

### Intensité Carbone (TCO2 MEUR Revenus)



Source : Sustainalytics
Définition : Exprimé en tonnes de CO2 par
million d'euros de revenu, l'indicateur
mesure la quantité de Gaz à effet de serre
(GES) produite par unité de revenu
générée par l'entreprise. Elle est pondérée
par la part de l'actif dans le portefeuille.

|   | Portefeuille                              | Univers de<br>départ                     | Source         | Définition de<br>l'indicateur  |
|---|---|--|----------------|--|
| VIOLATION UNGC*  * United Nations Global Compact: unglobalcompact.org | 2,25%<br>Couverture du<br>fonds : 97,45%  | 0,16%  Couverture de l'univers : 90,64%  | Sustainalytics | La part des actifs du fonds exposés à des entreprises qui violent les principes de l'UN Global Compact * ou les principes directeurs de l'OCDE.  |
| FEMMES SIÉGEANT<br>AU CONSEIL<br>D'ADMINISTRATION<br>(EN %)           | 43,96%<br>Couverture du<br>fonds : 84,00% | 41,21%  Couverture de l'univers : 72,01% | Sustainalytics | Moyenne pondérée<br>du pourcentage de<br>femmes siégeant au<br>conseil<br>d'administration des<br>entreprises.   |
| EXISTENCE D'UNE<br>POLITIQUE EN<br>MATIÈRE DE DROITS<br>HUMAINS       | 98,84%<br>Couverture du<br>fonds : 93,57% | 97,73%  Couverture de l'univers : 85,62% | Sustainalytics | La part des investissements dans des entités ayant une politique en matière des droits humains en ligne avec les principes directeurs des Nations unies en matière de droits de l'Homme. |

#### **Avertissement**

Ce document est une communication publicitaire qui 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 ou des DIC et du Règlement du ou des OPC, disponibles sur le site 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. Les performances passées ne préjugent pas des performances futures et ne sont pas constantes dans le temps. 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. 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. La source des données du présent document est SIENNA GESTION. La date des données du présent document est celle indiquée en tête du document sauf mention contraire.