

SIENNA ACTIONS BAS CARBONE R-C

Reporting au 30/09/2025

STRATÉGIE D'INVESTISSEMENT

Investi en actions de la zone euro, le fonds opère une sélection thématique de titres prenant en compte des critères Environnementaux, Sociaux et de bonne Gouvernance en plus des critères financiers. Il vise à investir dans une économie en faveur de la réduction de l'intensité carbone. Le fonds cherche à réduire de 7% par an en moyenne les émissions du fonds et d'avoir une empreinte inférieure de 40% à celle de son indice de référence.

ÉVOLUTION DE LA VL (BASE 100)



PERFORMANCES DU FONDS

Indice de référence

| TEM CHAN AVELS DO FONDS | | | | |
|---------------------------------|--------|-------|-------|------------------------|
| Performances cumulées (en %) | 1 mois | 2025 | 1 an | Depuis Création |
| Portefeuille | 2,68 | 12,71 | 8,87 | 23,37 |
| Indice de référence | 2,84 | 17,67 | 15,39 | 33,98 |
| | | | | |
| Performances annualisées (en %) | | | 1 an | Depuis Création |
| Portefeuille | | | 8,87 | 8,93 |

| | 13,33 | 12,05 |
|-------------------------------|-------|-------|
| | | |
| Performances annuelles (en %) | | 2024 |
| Portefeuille | | 5,72 |
| Indice de référence | | 9,49 |

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. Ces frais de souscription ne sont pas acquis par la société de gestion et sont versés au distributeur.

ALLOCATION D'ACTIFS DU PORTEFEUILLE

| Actions | | 101,0% |
|---------------------------------|-------------------------|--------|
| Obligations | 4,8% | |
| -5,8% Monétaire & Liquidités | | |
| Portefeui | lle Indice de référence | |

LES PRINCIPALES LIGNES HORS OPC

| Valeurs actions | Poids | Secteur |
|------------------------------|-------|------------------------------|
| ASML HOLDING NV | 5,14% | Technologie |
| SAP SE / XETRA | 4,05% | Technologie |
| SIEMENS AG-REG | 3,22% | Industries |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI | 2,85% | Consommation non essentielle |
| AIRBUS SE | 2,64% | Industries |

15 20

12 65

Actif net du portefeuille : 161,18 M€ Valeur liquidative de la part : 124,220 €

CARACTÉRISTIQUES

Date de création : 18/04/2023 Durée de placement : > 5 ans Indicateur de risque (SRI) (1) :



Forme juridique : FCP

Classification AMF: Actions de pays de la zone euro

Article SFDR (2): 8
Code ISIN: FR001400EG93

Devise : Euro

Indice de référence : (Dividendes réinvestis) 100% MSCI EMU NR EUR

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: 1,50%

Coûts de transaction: 0.22%

Affectation des resultats : Capitalisation

Principaux risques : Risque de perte en capital Risque actions Risque de durabilité

(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.

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

INDICATEURS DE RISQUE

Volatilité annualisée

Portefeuille (en %)

Indice de référence (en %)

Tracking error (en %)

1 an Depuis Création

| 15,44 | 13,52 |
|-------|-------|
| 15,47 | 13,59 |
| 2,33 | 2,04 |



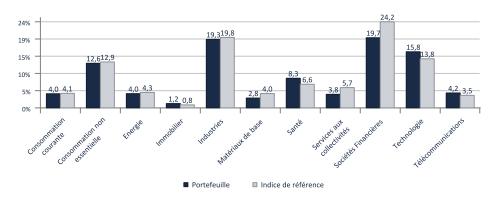
PRINCIPAUX CONTRIBUTEURS A LA PERFORMANCE DU MOIS

| Meilleurs contributeurs | Contribution |
|-------------------------|--------------|
| ASML HOLDING NV | 1,23% |
| SCHNEIDER ELECT SE | 0,31% |
| ASM INTERNATIONAL NV | 0,31% |
| AIRBUS SE | 0,25% |
| PROSUS NV | 0,23% |

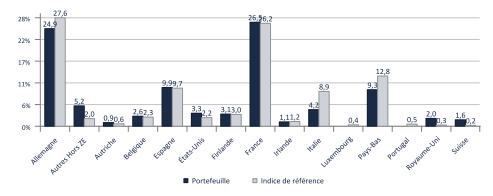
| Moins bons contributeurs | Contribution |
|------------------------------|--------------|
| DEUTSCHE TELEKOM NAM (XETRA) | -0,21% |
| PERNOD RICARD | -0,17% |
| SANOFI - PARIS | -0,16% |
| SIEMENS AG-REG | -0,11% |
| DEUTSCHE BOERSE AG | -0,11% |

ANALYSE DU PORTEFEUILLE - ACTIONS

Répartition sectorielle hors OPC (en % d'actif)



Répartition géographique hors OPC (en % d'actif)



Répartition par typologie de secteurs hors OPC



ANALYSE EXTRA-FINANCIÈRE

Note risque ESG

| | Portefeuille | Univers de départ |
|---|--------------|-------------------|
| Note risque ESG moyenne pondérée | 16,80 | 19,07 |
| Taux de couverture (en % de l'actif) | 97,29% | 97,41% |

Note risque ESG du portefeuille : 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 du pilier E | Contribution du pilier S | Contribution du pilier G |
|-------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------------------|
| Portefeuille | 23,83% | 47,48% | 28,68% |
| Univers de départ | 24,89% | 47,51% | 27,60% |

^{*} 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 : MSCI Europe (MXEU).

Controverses par niveau de gravité

| Niveau de controverse | % de l'actif du fonds (hors OPC, dérivés, liquidités, souverains) exposé à des controverses | % de l'univers de départ exposé à des controverses |
|-------------------------------|--|---|
| Aucune controverse identifiée | 7,97% | 7,38% |
| Niveau 1 | 11,70% | 14,20% |
| Niveau 2 | 62,19% | 52,18% |
| Niveau 3 | 18,05% | 21,15% |
| Niveau 4 | 0,09% | 4,40% |
| Niveau 5 | 0,00% | 0,68% |
| Taux de couverture | 97,31% | 97,53% |

Intensité carbone

| | Intensité carbone (TCO2/M€ investis)* | Taux de couverture |
|--|--|--------------------|
| Portefeuille** | 80,44 | 96,68% |
| Indice de référence : MSCI EMU NR EUR | 146,78 | 96,67% |
| Variation du portefeuille par rapport à l'indice de référence | -45,20% | |

^{*} L'intensité carbone du portefeuille est calculée à partir des données de l'agence S&P Global Trucost, dont la méthodologie du calcul des émissions carbone diffère légèrement de celle du GHG Protocol (Greenhouse Gas Protocol). Elle comprend :

Ainsi les Scopes 1, 2 et une partie du Scope 3 du GHG Protocol sont couverts par cette méthodologie de calcul de l'intensité carbone. Pour plus d'informations, voir https://www.spglobal.com/spdji/en/documents/additional-material/faq-trucost.pdf

les émissions directes des entités détenues ou contrôlées par l'entreprise ainsi que toutes les autres émissions dérivées des opérations de l'entreprise

les émissions indirectes liées à la consommation d'énergie ainsi que les émissions des fournisseurs directs de l'entreprise

^{**} L'intensité carbone du portefeuille est calculée sur les actifs cotés du portefeuille à l'exclusion du cash et des OPC investis.

ANALYSE EXTRA-FINANCIÈRE

| | Portefeuille | Univers de départ | Source | Définition de l'indicateur |
|---|--|---|----------------|--|
| VIOLATION UNGC* * United Nations Global Compact: unglobalcompact.org | 0,00% Couverture du fonds : 100,00% | 0,00% Couverture de l'univers : 99,96% | 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 AU CONSEIL D'ADMINISTRATION (EN %) | 41,55% Couverture du fonds : 97,75% | 41,68% Couverture de l'univers : 97,50% | Sustainalytics | Moyenne pondérée du pourcentage de femmes siégeant au conseil d'administration des entreprises. |
| EXISTENCE D'UNE POLITIQUE EN MATIÈRE DE DROITS HUMAINS | 100,00% Couverture du fonds : 97,75% | 99,64% Couverture de l'univers : 97,38% | 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.