

SIENNA COURT TERME R-C

Reporting au 30/09/2025

STRATÉGIE D'INVESTISSEMENT

Investi en monétaire et obligations de court terme (1-3 ans), le fonds opère une sélection de titres prenant en compte des critères Environnementaux, Sociaux et de bonne Gouvernance en plus des critères financiers. Son objectif est de procurer une performance supérieure à celle du marché monétaire en profitant des primes obligataires, et d'optimiser une trésorerie moyen terme.

ÉVOLUTION DE LA VL (BASE 100)

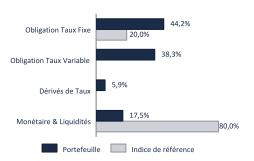


PERFORMANCES DU FONDS

Performances cumulées (en %)	1 mois	2025	1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Portefeuille	0,14	1,88	2,74	9,96	7,62	6,10
Indice de référence	0,15	1,76	2,56	8,92	6,66	4,73
Performances annualisées (en %)			1 an	3 ans	5 ans	10 ans
Portefeuille			2,74	3,21	1,48	0,59
Indice de référence			2,56	2,89	1,30	0,46
Performances annuelles (en %)		2024	2023	2022	2021	2020
Portefeuille		3,98	3,35	-1,22	-0,58	-0,38
Indice de référence		3,74	3,19	-1,48	-0,55	-0,32

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



Valeurs	Poids
CCBGBB FRN 09/27 EMTN	1,97%
REGCEN FRN 01/29 EMTN	1,83%
BRFDFR FRN 01/29 EMTN	1,83%
ALPAZU FRN 01/30 EMTN	1,83%
RLOIRE FRN 05/30 EMTN	1,65%

LES PRINCIPALES LIGNES HORS OPC

Actif net du portefeuille : 548,27 M€ Valeur liquidative de la part : 288,704 €

CARACTÉRISTIQUES

Date de création : 30/12/1994 Durée de placement : > 6 mois Indicateur de risque (SRI) (1):



Forme juridique: FCP

Classification AMF: Obligations et autres titres de

créance libellés en euro

Code ISIN: FR0007391255

Devise: Furo Indice de référence :

Article SFDR (2): 8

20% Bloomberg Euro-Aggregate: Treasury -- 1-3 Year 80% ECB Euro Short-term Rate Capitalisé

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: 0,32%

Coûts de transaction: 0,34%

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.

Article 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
0,24	0,29	0,34
0,25	0,43	0,44



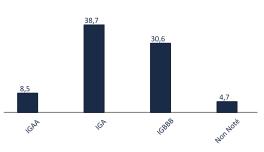
SENSIBILITÉ

	Date du rapport Mois précédent			
Portefeuille	0,85	0,74		
Indice de référence	0.39	0.39		

0,74 0,43 0,39 0,37

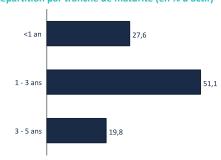
ANALYSE DU PORTEFEUILLE - TAUX

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

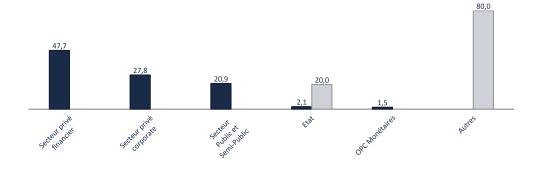


Répartition par tranche de maturité (en % d'actif)

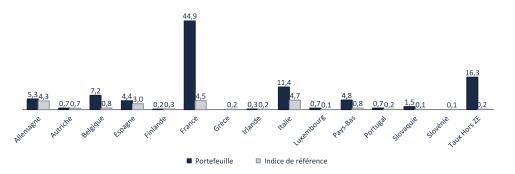
31/12/2024



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 moyenne pondérée	17,33	18,81
Taux de couverture (en % de l'actif)	91,29%	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.

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.