SIENNA OBLIGATIONS R-C

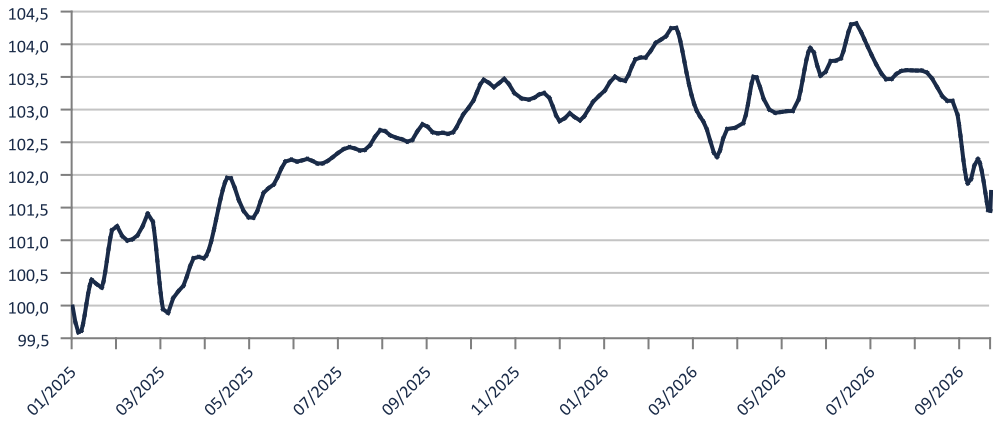
Reporting au 30/09/2026

Actif net du portefeuille : 141,25 M€
Valeur liquidative de la part : 101,755 €

STRATÉGIE D'INVESTISSEMENT

Investi en obligations de la zone euro, le fonds suit une gestion en fonds de fonds au travers d'une sélection d'OPCVM obligataires prenant en compte des critères Environnementaux, Sociaux et de bonne Gouvernance. Son univers d'investissement est large, couvrant les obligations d'état et les obligations d'entreprises avec des durations de court terme (1-3 ans) à moyen terme (7 ans).

ÉVOLUTION DE LA VL (BASE 100)



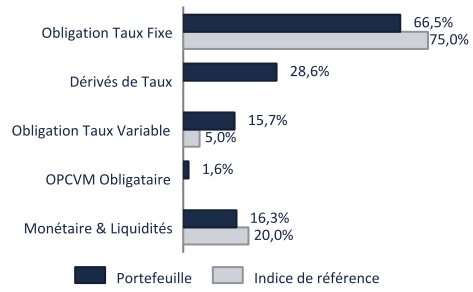
PERFORMANCES DU FONDS

Performances cumulées (en %)	1 mois	2026	1 an
Portefeuille	-1,35	-1,34	-1,03
Indice de référence	-1,02	-0,89	-0,54

Performances annualisées (en %)	1 an
Portefeuille	-1,03
Indice de référence	-0,54

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*



LES PRINCIPALES LIGNES HORS OPC*

Valeurs	Poids
BTPS 4.1% 02/29 5Y	3,70%
BTPS 5.25% 11/29	3,57%
OAT 0.5% 05/29 OAT	3,53%
OAT 2.5% 5/30	3,13%
OAT 5.50% 97-04/29	3,06%

** Les données affichées sont calculées par transparisation des OPC sous-jacents hors OPC Monétaires.*

CARACTÉRISTIQUES

Date de création : 08/01/2025

Durée de placement : > 3 ans

Indicateur de risque (SRI) (1) :

1	**2**	3	4	5	6	7

Risque le plus faible — Risque le plus élevé

Forme juridique : FCP

Classification AMF : Obligations et autres titres de créance libellés en euro

Article SFDR (2) : 8

Code ISIN : FR001400SGG5

Devise : Euro

Indice de référence :
(Coupons nets réinvestis)
40% Bloomberg Euro-Aggregate: Treasury -- 3-5 Year
20% ECB Euro Short-term Rate Capitalisé
40% Bloomberg Euro-Aggregate : Corporates -- 500MM

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 : 0,63%

Coûts de transaction : 0,00%

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.

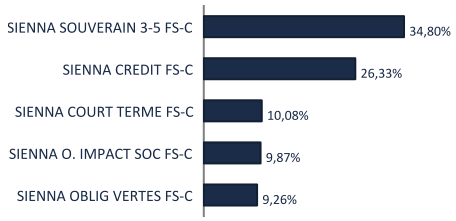
Article 8 : Produit financier qui promeut des caractéristiques environnementales et/ou sociales.

Sienna Gestion, membre du groupe Sienna Investment Managers - Société anonyme à Directoire et Conseil de surveillance au capital de 9 824 748 € - RCS : 320 921 828 Paris - N° Agrément AMF : GP 97020 en date du 13 mars 1997 - N° TVA intracommunautaire : FR 47 320 921 828 - Code APE : 6430Z - Siège social : 21 boulevard Haussmann 75009 Paris | www.sienna-gestion.com

INDICATEURS DE RISQUE

	1 an
Volatilité annualisée	
Portefeuille (en %)	2,54
Indice de référence (en %)	2,22

RÉPARTITION PAR SUPPORT



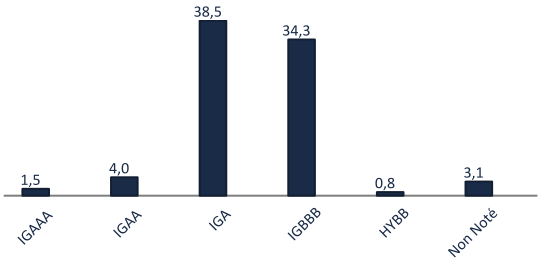
Retrouvez notre analyse des tendances et nos convictions

SENSIBILITÉ*

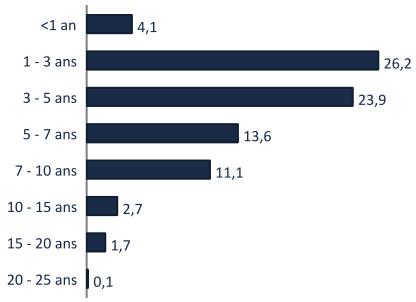
	Date du rapport	Mois précédent	31/12/2025
Portefeuille	3,99	3,68	3,77
Indice de référence	3,25	3,24	3,26

ANALYSE DU PORTEFEUILLE - TAUX

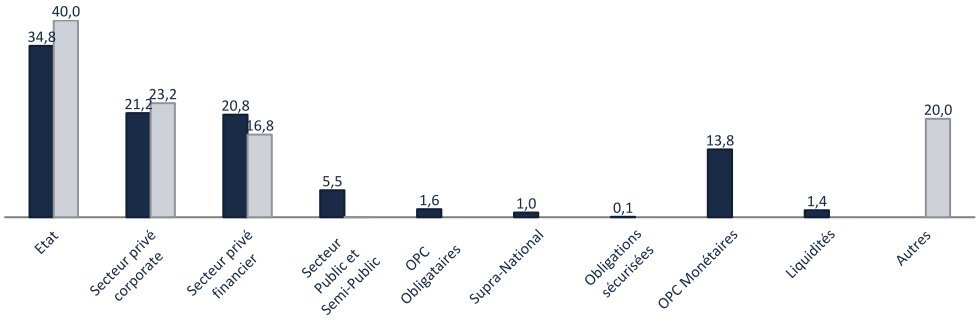
Répartition par notation long terme (en % d'actif)*



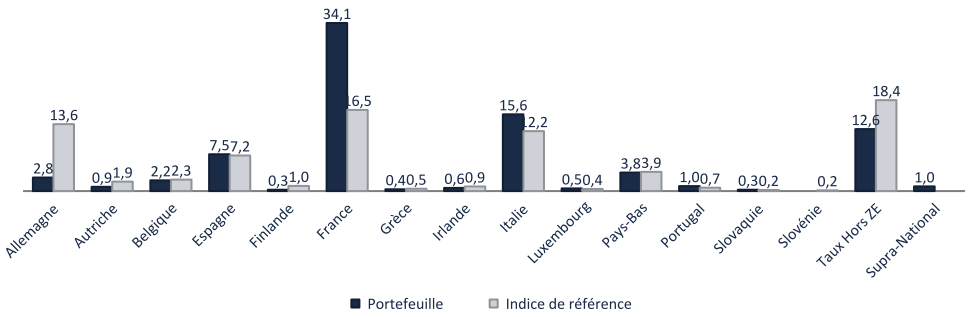
Répartition par tranche de maturité (en % d'actif) *



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



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



** Les données affichées sont calculées par transparisation des OPC sous-jacents hors OPC Monétaires.*

ANALYSE EXTRA-FINANCIÈRE

Note risque ESG

	Portefeuille	Univers de départ
Note risque ESG moyenne pondérée	15,82	16,03
Taux de couverture (en % de l'actif)	88,67%	99,15%

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.

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.