# SIENNA TRESORERIE PLUS B

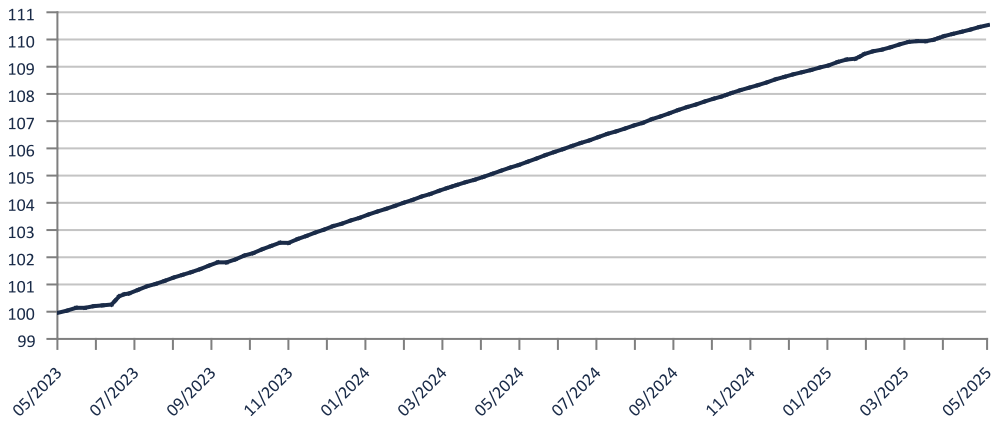
**Reporting au 30/05/2025**

**Actif net du portefeuille :** 136,55 M€
**Valeur liquidative de la part :** 1 106,117 €

## STRATÉGIE D'INVESTISSEMENT

Sienna Trésorerie Plus est un fonds de financement spécialisé qui a pour objectif, sur sa durée de placement recommandée d'un an minimum, une performance, nette de frais de gestion, de eurosSTR capitalisé + 125 points de base. Le fonds intègre une approche extra-financière (critères Environnementaux, Sociaux et de Gouvernance dits ' critères ESG ') pour la sélection et le suivi des titres. Le fonds est composé jusqu'à 100% d'une poche liquide constituée du fonds Sienna Court Terme ISR part G et jusqu'à 70% de FIA de dettes privées à court terme gérées par Sienna AM.

## ÉVOLUTION DE LA VL (BASE 100)




## PERFORMANCES DU FONDS

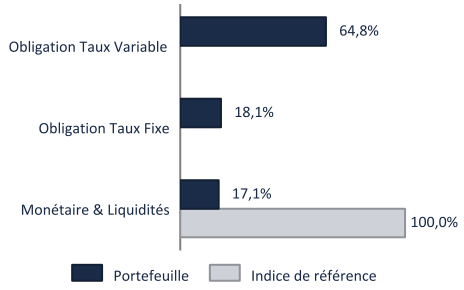
| Performances cumulées (en %) | 1 mois | 2025 | 1 an |
|---|---|---|---|
| Portefeuille | 0,35 | 1,62 | 4,76 |
| Indice de référence | 0,18 | 1,06 | 3,15 |

| Performances annualisées (en %) | 1 an |
|---|---|
| Portefeuille | 4,76 |
| Indice de référence | 3,15 |

| Performances annuelles (en %) | 2024 |
|---|---|
| Portefeuille | 5,42 |
| Indice de référence | 3,79 |

*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 |
|---|---|
| Portefeuille de créances 2 | 29,24% |
| Portefeuille de créances 3 | 6,67% |
| Portefeuille de créances 1 | 4,82% |
| Portefeuille de créances 4 | 4,07% |
| Portefeuille de créances 6 | 3,34% |

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

## CARACTÉRISTIQUES

**Date de création :** 26/05/2023

**Durée de placement :** > 1 an

**Indicateur de risque (SRI) (1) :**

| 1 | **2** | 3 | 4 | 5 | 6 | 7 |
|---|---|---|---|---|---|---|

Risque le plus faible — Risque le plus élevé

**Forme juridique :** Fonds Professionnel Spécialisé

**Classification AMF :** sans classification

**Article SFDR (2) :** 6

**Code ISIN :** FR001400EBM4

**Devise :** Euro

**Indice de référence :**
*(Coupons nets réinvestis)*
100% 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 :** 1,12%

**Coûts de transaction :** 0,00%

**Affectation des resultats :** Capitalisation

**Principaux risques :**
Risque de perte en capital
Risque de liquidité
Risque de crédit
Risque de taux
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.*

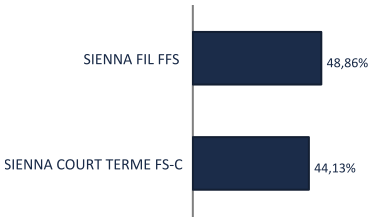
*Article 6 : Produit financier qui ne fait pas la promotion de caractéristiques environnementales et/ou sociales et qui n'a pas d'objectif d'investissement durable.*

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 %) | 0,39 |
| Indice de référence (en % ) | 0,12 |

## RÉPARTITION PAR SUPPORT



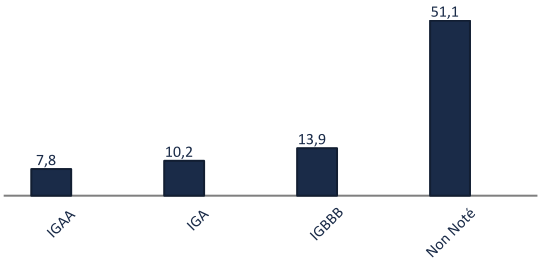

**Retrouvez notre analyse des tendances et nos convictions**

## SENSIBILITÉ*

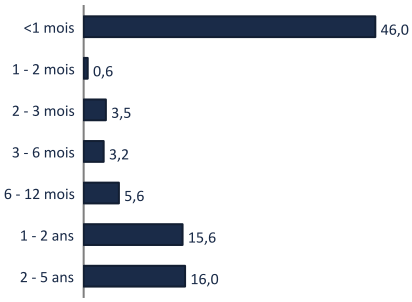
| | Date du rapport | Mois précédent | 31/12/2024 |
|---|---|---|---|
| Portefeuille | 0,26 | 0,24 | 0,17 |

## ANALYSE DU PORTEFEUILLE - TAUX

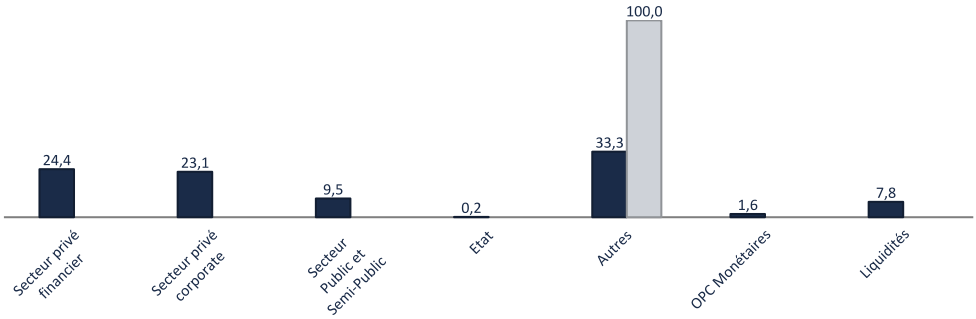
### Répartition par notation long terme (en % d'actif)*



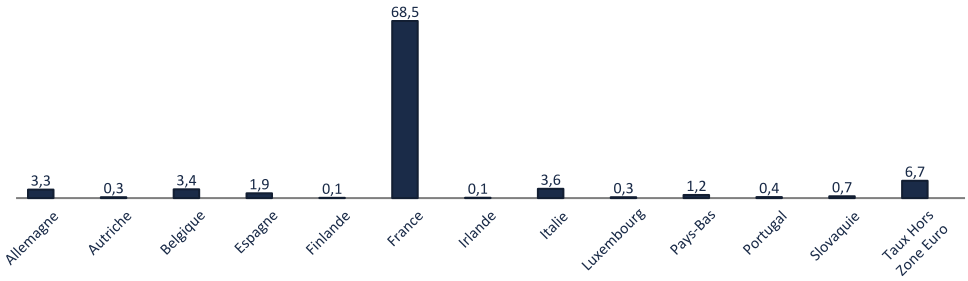

### Répartition par tranche de maturité (en % d'actif) *




### 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 DU FONDS FIL

## Portefeuille du fonds FIL

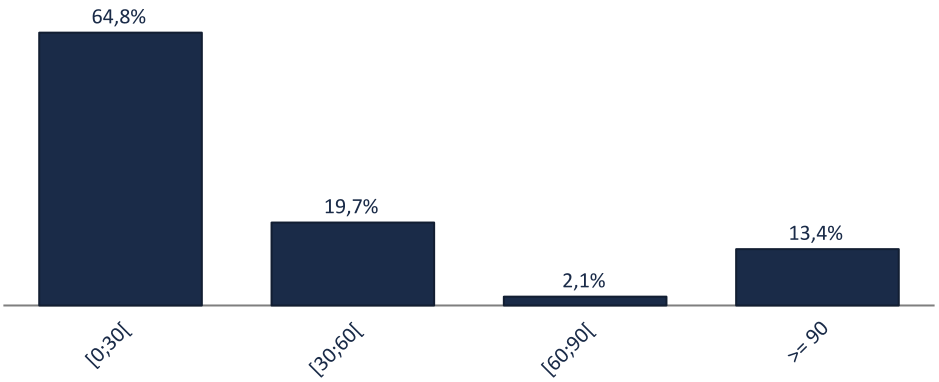
| Opérations | Date de signature | Exposition du fonds | Réserve de garantie |
|---|---|---|---|
| Portefeuille de créances 1 | 31/03/2023 | 6 500 000,00 € | Oui |
| Portefeuille de créances 2 | 02/05/2023 | 39 500 000,00 € | Oui |
| Portefeuille de créances 3 | 02/06/2023 | 9 000 000,00 € | Oui |
| Portefeuille de créances 4 | 01/03/2024 | 5 500 000,00 € | Oui |
| Portefeuille de créances 5 | 15/04/2024 | 990 000,00 € | Oui |
| Portefeuille de créances 6 | 30/04/2024 | 4 500 000,00 € | Oui |
| Total | | 65 990 000,00 € | |

## Portefeuilles de créances financées (hors cash) du fonds FIL (*)

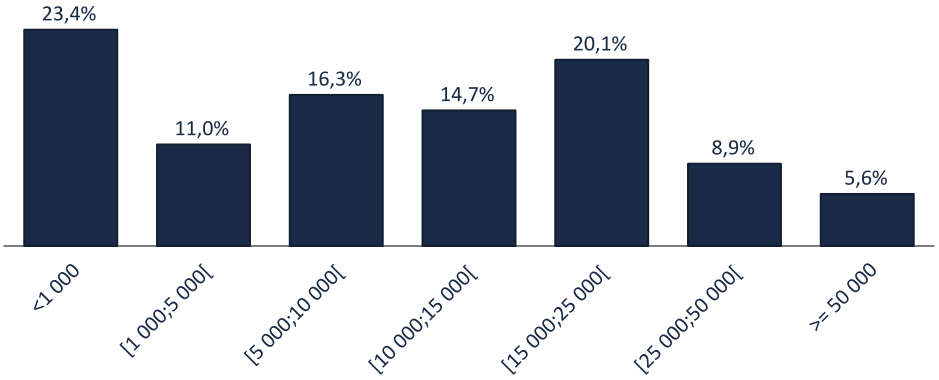
(*) Le portefeuille du fonds FIL est constitué de créances en vie et du cash provenant du remboursement des créances (ce montant de cash sera reprêté)

| | |
|---|---|
| Maturité moyenne des créances | 52.9 |
| Montant moyen des créances | 2 409,68 € |
| Montant médian des créances | 53,27 € |
| Nombre total de créances | 219 300 |

## Répartition des créances par tranche de maturité (en jours)




## Répartition des créances par tranche de montant (en euros)




## Le Fonds FIL en Bref

Le fonds FIL constitue la poche « dette privée » du fonds Sienna Trésorerie Plus.

Le fonds investit dans des portefeuilles diversifiés de créances et prêts < 12 mois. Les maturités sont indiquées par tranches de 30 jours.

Les portefeuilles bénéficient de rehaussements sous formes de dépôts espèces et/ou de garanties et/ou de sur-collatéralisation permettant à l'exposition du fonds d'être réhaussée au niveau d'un score interne SPC équivalent à un risque de crédit « investment grade ». ATTENTION, il ne s'agit pas d'une notation externe par une agence de notation. C'est une mesure interne.

Les structures juridiques mises en place permettent d'isoler les actifs et les encaissements au profit du fonds.

Les portefeuilles font l'objet de suivis sur la base de KPI permettant de contrôler les retards et les défauts et de réajuster les expositions ou les réserves de façon dynamique.

## 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.