



NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

OPCVM de droit français

OSTRUM SRI MONEY

RAPPORT SEMESTRIEL

au 29 décembre 2022

Société de gestion : Natixis Investment Managers International

Dépositaire : CACEIS Bank

Commissaire aux comptes : Mazars

**• ETAT DU PATRIMOINE EN EUR**

Eléments de l'état du patrimoine	Montant à l'arrêté périodique *
a) Titres financiers éligibles mentionnés au 1° du I de l'article L. 214-20 du code monétaire et financier	8 560 839 268,53
b) Avoirs bancaires	969 030 808,43
c) Autres actifs détenus par l'OPC	1 018 251 341,37
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	10 548 121 418,33
e) Passif	-9 658 713,65
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	10 538 462 704,68

* Les montants sont signés

• NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
OSTRUM SRI MONEY I C en EUR	C	9 565 847 828,76	774 621,38141	12 349,06
OSTRUM SRI MONEY I-D en EUR	D	55 771 840,76	4 643,56955	12 010,55
OSTRUM SRI MONEY Part I 1 en EUR	C/D	11 907 023,83	31 884,89548	373,437
OSTRUM SRI MONEY Part R 1 en EUR	C/D	15 738 741,01	131 948,25842	119,279
OSTRUM SRI MONEY R en EUR	C	249 608 001,49	25 327,33879	9 855,27
OSTRUM SRI MONEY RE C en EUR	C	628 786 305,33	63 738,13584	9 865,15
OSTRUM SRI MONEY T C en EUR	C	10 802 963,50	1 096,12059	9 855,63



● ELÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	74,48	74,41
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	6,75	6,75
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	9,60	9,59

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

**● RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE**

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Euro	EUR	8 560 839 268,53	81,23	81,16
TOTAL		8 560 839 268,53	81,23	81,16

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

**• RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR**

Pays	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
FRANCE	43,60	43,56
LUXEMBOURG	8,88	8,87
PAYS-BAS	6,18	6,17
ESPAGNE	5,51	5,50
ROYAUME-UNI	4,29	4,28
SUEDE	2,92	2,92
ITALIE	2,51	2,51
ALLEMAGNE	2,14	2,14
CANADA	2,13	2,13
IRLANDE	1,71	1,70
BELGIQUE	0,52	0,52
FINLANDE	0,47	0,47
ETATS-UNIS	0,33	0,33
AUTRICHE	0,05	0,05
TOTAL	81,23	81,16

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine

**• RÉPARTITION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE**

Nature d'actifs	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
Organismes de placement collectif		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	9,60	9,59
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE	0,00	0,00
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés	0,00	0,00
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés	0,00	0,00
Autres organismes non européens	0,00	0,00
Autres actifs		
Autres	0,00	0,00
TOTAL	9,60	9,59

* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

** Se reporter au d) de l'état du patrimoine



● MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

Éléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	26 764 421 063,69	25 387 930 547,67
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	625 221 118,93	855 666 800,00
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	517 588 243,34	359 006 484,46

● DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt (1) EUR	Montant brut unitaire (2) EUR
Dividendes versés			
Dividendes à verser			
	OSTRUM SRI MONEY I-D		
	OSTRUM SRI MONEY Part I 1		
	OSTRUM SRI MONEY Part R 1		

(1) Le crédit d'impôt unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

(2) Le montant brut unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

● INFORMATIONS DIVERSES

Etablissement dépositaire : CACEIS Bank - 12 place des États-Unis - CS 40083 - 92549 - Montrouge Cedex

Le relevé Périodicité Semestrielle détaillé de l'actif est disponible dans un délai de huit semaines à compter de la fin de la période. Il peut être transmis sur simple demande auprès de la société de gestion :

Natixis Investment Managers International - 43 avenue Pierre Mendès France - 75013 - Paris

**• INFORMATION SUR LES FRAIS DE GESTION VARIABLES**

	29/12/2022
Parts OSTRUM SRI MONEY I C	
Frais de gestion variables provisionnés	960 943,19
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,02
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Parts OSTRUM SRI MONEY I-D	
Frais de gestion variables provisionnés	5 628,44
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,02
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Parts OSTRUM SRI MONEY Part I 1	
Frais de gestion variables provisionnés	1 800,40
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,02
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Parts OSTRUM SRI MONEY Part R 1	
Frais de gestion variables provisionnés	1 042,14
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,01
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Parts OSTRUM SRI MONEY R	
Frais de gestion variables provisionnés	20 607,90
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,02
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Parts OSTRUM SRI MONEY RE C	
Frais de gestion variables provisionnés	34 621,88
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,01
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Parts OSTRUM SRI MONEY T C	
Frais de gestion variables provisionnés	651,75
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,01
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00

« Le montant des frais de gestion variables affiché ci-dessus correspond à la somme des provisions et reprises de provisions ayant impacté l'actif net au cours de la période sous revue. »



- **TRANSPARENCE DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA RÉUTILISATION DES INSTRUMENTS FINANCIERS - RÈGLEMENT SFTR - EN DEVISE DE COMPTABILITÉ DE L'OPC (EUR)**

Au cours de l'exercice, l'OPC n'a pas fait l'objet d'opérations relevant de la réglementation SFTR.



• PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/12/2022 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
VONOVIA SE 0.0% 01-09-23 EMTN	EUR	15 800 000	15 452 874,00	0,15
TOTAL ALLEMAGNE			15 452 874,00	0,15
CANADA				
Bank of Nova Scotia OISEST+1.0% 20-12-23	EUR	16 700 000	16 804 441,26	0,16
BANK OF NOVA SCOTIA TORONTO E3R+0.75% 01-02-24	EUR	15 000 000	15 143 582,50	0,14
BANK OF NOVA SCOTIA TORONTO E3R+0.75% 06-09-23	EUR	25 000 000	25 138 574,31	0,24
CAN IMP BK E3R+0.75% 26-01-24	EUR	25 000 000	25 249 577,78	0,24
NATL BANK OF CANADA E3R+0.75% 01-02-24	EUR	23 200 000	23 417 666,27	0,22
ROYAL BANK OF CANADA TORONTO E3R+0.75% 31-01-24	EUR	20 000 000	20 197 391,67	0,19
TOTAL CANADA			125 951 233,79	1,19
ESPAGNE				
BANCO NTANDER E3R+0.75% 28-03-23	EUR	17 200 000	17 223 053,26	0,17
BANCO NTANDER E3R+1.0% 05-05-24	EUR	46 100 000	46 685 295,84	0,44
BBVA E3R+0.6% 09-03-23 EMTN	EUR	55 300 000	55 410 692,17	0,52
BBVA E3R+0.7% 11-07-24 EMTN	EUR	40 000 000	40 243 702,22	0,38
BBVA E3R+1.0% 09-09-23 EMTN	EUR	74 700 000	75 222 443,50	0,71
IBERDROLA FINANZAS SAU E3R+0.65% 04-12-23	EUR	25 000 000	25 110 225,00	0,24
IBERDROLA FINANZAS SAU E3R+0.65% 28-04-23	EUR	30 000 000	30 134 313,33	0,29
TOTAL ESPAGNE			290 029 725,32	2,75
ETATS-UNIS				
BK AME 0.75% 26-07-23 EMTN	EUR	18 000 000	17 875 178,63	0,16
GOLD SACH GR E3R+1.0% 30-04-24	EUR	10 000 000	10 044 893,06	0,10
TOTAL ETATS-UNIS			27 920 071,69	0,26
FRANCE				
BFCM 2.625% 03/24	EUR	27 100 000	27 490 741,16	0,26
BFCM BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL 0.75% 15-06-23	EUR	10 500 000	10 465 223,42	0,10
BN 1.125% 15-01-23 EMTN	EUR	40 000 000	40 420 641,10	0,38
BNP PAR E3R+0.62% 22-05-23	EUR	12 618 000	12 670 980,53	0,12
BPCE 1.125% 18-01-23 EMTN	EUR	14 800 000	14 954 268,71	0,14
BPCE E3R+0.5% 23-03-23 EMTN	EUR	15 500 000	15 515 866,83	0,15
ENGIE 3% 02/23	EUR	5 399 000	5 550 255,57	0,05
HSBC CONTINENTAL EUROPE E3R+1.0% 26-11-23	EUR	25 000 000	25 206 352,78	0,24
SG E3R+0.45% 06-03-23 EMTN	EUR	11 600 000	11 622 379,94	0,11
VILOGIA STE ANONYME D HLM E3R+0.75% 27-07-23	EUR	20 600 000	20 730 238,35	0,20
TOTAL FRANCE			184 626 948,39	1,75
IRLANDE				
INTESA BANK IRELAND E3R+0.7% 20-01-23	EUR	30 000 000	30 131 256,67	0,29
TOTAL IRLANDE			30 131 256,67	0,29
ITALIE				
INTESA SANPAOLO E3R+0.6% 17-03-23	EUR	2 900 000	2 886 417,27	0,04
UNICR 2.0% 04-03-23 EMTN	EUR	16 000 000	16 257 413,70	0,15
TOTAL ITALIE			19 143 830,97	0,19
LUXEMBOURG				
CODEIS SECURITIES OISEST+0.075% 21-02-23	EUR	250 000 000	250 321 841,81	2,38



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/12/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.0% 15-03-23	EUR	10 000 000	9 957 700,00	0,09
PURPLE PROTECTED ASSET OISEST+0.02% 17-11-23	EUR	275 000 000	275 490 355,25	2,61
PURPLE PROTECTED ASSET OISEST+0.02% 18-10-23	EUR	100 000 000	100 266 454,00	0,95
SG ISSUER OISEST+0.07% 16-06-23	EUR	100 000 000	100 287 232,56	0,95
SG ISSUER OISEST+0.075% 03-02-23	EUR	50 000 000	50 051 863,19	0,48
TOTAL LUXEMBOURG			786 375 446,81	7,46
PAYS-BAS				
BMW FIN 0.0% 24-03-23 EMTN	EUR	18 600 000	18 530 808,00	0,18
DAIMLER INTL FINANCE BV 0.625% 27-02-23	EUR	28 185 000	28 256 381,41	0,26
DAIMLER INTL FINANCE BV E3R+0.25% 11-01-23	EUR	9 700 000	9 731 574,04	0,09
DE VOLKSBANK NV E3R+0.55% 12-09-24	EUR	25 000 000	25 153 736,11	0,24
HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV E3R+0.55% 19-01-24	EUR	25 000 000	23 983 680,56	0,23
THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE I BV E3R+0.2% 18-11-23	EUR	55 000 000	55 045 165,69	0,52
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0.75% 19-01-23	EUR	15 000 000	15 066 670,00	0,15
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0.75% 24-05-23	EUR	30 000 000	30 149 112,50	0,29
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0.75% 28-04-23	EUR	15 000 000	15 070 700,00	0,14
TOTAL PAYS-BAS			220 987 828,31	2,10
ROYAUME-UNI				
BARCLAYS BK E3R+0.18% 20-01-23	EUR	20 000 000	20 006 515,56	0,19
BARCLAYS BK ZCP 26-01-23	EUR	50 000 000	49 923 700,00	0,47
CASA LONDON E3R+0.6% 06-03-23	EUR	19 600 000	19 644 984,72	0,19
HSBC BK E3R+1.0% 08-03-23 EMTN	EUR	103 300 000	103 634 270,19	0,98
UBS AG LONDON 0.75% 21-04-23	EUR	24 448 000	24 466 778,07	0,23
TOTAL ROYAUME-UNI			217 676 248,54	2,06
SUEDE				
VATTENFALL AB E3R+0.5% 18-04-24	EUR	13 700 000	13 784 337,20	0,13
VOLVO TREASURY AB AUTRE V 27-09-23	EUR	15 000 000	15 047 620,83	0,14
VOLVO TREASURY AB E3R+0.75% 13-09-23	EUR	50 000 000	50 180 722,22	0,48
TOTAL SUEDE			79 012 680,25	0,75
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			1 997 308 144,74	18,95
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			1 997 308 144,74	18,95
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
DEUTSCHE TELEKOM AG 010223 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 908 446,28	0,48
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 130123 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 992 263,99	0,09
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 240123 FIX 0.0	EUR	9 000 000	8 987 574,68	0,09
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 280323 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 977 076,13	0,04
FRES MEDI CARE AG ZCP 08-03-23	EUR	20 000 000	19 914 692,98	0,19
SANTANDER CONSUMER BANK AG 011223 FIX 0.	EUR	25 000 000	24 252 041,18	0,23
SANTANDER CONSUMER BANK AG 021123 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 334 122,69	0,23
SANTANDER CONSUMER BANK AG 150323 FIX 0.	EUR	50 000 000	49 771 868,57	0,48
SAP SE 020323 FIX 0.0	EUR	14 000 000	13 947 744,47	0,13
SCHAEFFLER AG 020223 FIX 0.0	EUR	2 000 000	1 995 186,07	0,01



● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/12/2022 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SCHAEFFLER AG 090123 FIX 0.0	EUR	3 000 000	2 997 900,47	0,03
TOTAL ALLEMAGNE			210 078 917,51	2,00
AUTRICHE				
BELGIQUE				
COFINIMMO SA 240123 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 993 271,91	0,05
SUMITOMO MITSU 010223 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 907 587,78	0,47
TOTAL BELGIQUE			54 900 859,69	0,52
CANADA				
Bank of Montreal 071123 OISEST 0.4	EUR	25 000 000	25 088 564,81	0,24
ROYAL BANK OF CANADA 100823 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 571 223,08	0,23
TORONTO DOMINION BANK, THE 080523 FIX 0.	EUR	25 000 000	24 807 950,90	0,24
TORONTO DOMINION BANK, THE 140823 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 571 430,10	0,23
TOTAL CANADA			99 039 168,89	0,94
ESPAGNE				
BANCO SANTANDER SA 060223 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 895 612,83	0,47
BANCO SANTANDER SA 270323 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 734 006,37	0,47
ENDESA SA 250123 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 961 330,74	0,24
ENDESA SA 260123 FIX 0.0	EUR	99 000 000	98 840 989,56	0,93
FERROVIAL SA 020223 FIX 0.0	EUR	9 000 000	8 983 307,27	0,09
FERROVIAL SA 090123 FIX 0.0	EUR	2 000 000	1 998 928,35	0,02
TOTAL ESPAGNE			234 414 175,12	2,22
FRANCE				
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 060323 FIX 0.0	EUR	16 000 000	15 934 725,00	0,15
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 160123 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 976 705,75	0,24
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 270323 FIX 0.0	EUR	8 500 000	8 451 370,11	0,08
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 310123 FIX 0.0	EUR	13 500 000	13 476 016,28	0,13
ALSTOM SA 130323 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 882 839,15	0,24
ALSTOM SA 160123 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 996 329,48	0,04
ALSTOM SA 160223 FIX 0.0	EUR	11 000 000	10 968 863,05	0,11
ALSTOM SA 200223 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 984 406,89	0,04
ARKEA- COMPAGNIE FINANCI 210323 OISEST 0.14	EUR	50 000 000	50 152 819,03	0,47
ARKEMA 120923 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 472 439,46	0,23
AXA SA 130423 FIX 0.0	EUR	8 000 000	7 944 995,03	0,08
AXA SA 200323 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 874 406,36	0,23
BEL SA 050123 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 997 187,36	0,07
BFCM (BANQUE FEDER 100723 OISEST 0.28	EUR	50 000 000	50 087 750,81	0,47
BFCM (BANQUE FEDER 200723 OISEST 0.19	EUR	50 000 000	50 032 964,86	0,48
BFCM (BANQUE FEDER 220523 OISEST 0.18	EUR	50 000 000	50 098 126,19	0,47
BFCM (BANQUE FEDER 230523 OISEST 0.21	EUR	50 000 000	50 103 214,86	0,48
BFCM (BANQUE FEDER 290523 OISEST 0.21	EUR	50 000 000	50 090 494,00	0,48
BFCM (BANQUE FEDERATIVE 110423 OISEST 0.18	EUR	50 000 000	50 113 131,08	0,48
BNP PARIBAS 010223 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 909 761,49	0,47
BNP PARIBAS 100223 OISEST 0.14	EUR	100 000 000	100 369 607,44	0,95
BNP PARIBAS 200323 OISEST 0.11	EUR	30 000 000	30 109 804,85	0,28
BNP PARIBAS 210323 OISEST 0.1	EUR	20 000 000	20 071 372,22	0,19
BNP PARIBAS 210423 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 628 605,98	0,47
BNP PARIBAS 220923 FIX 0.0	EUR	50 000 000	48 908 030,14	0,46



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/12/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BONDUELLE 301222 FIX 0.0	EUR	6 000 000	6 000 000,00	0,06
BPCE OISEST+0.17% 04-05-23	EUR	50 000 000	50 140 011,56	0,48
BPCE OISEST+0.19% 09-06-23	EUR	50 000 000	50 129 400,17	0,47
BPCE SA 190623 OISEST 0.19	EUR	75 000 000	75 163 846,54	0,72
BPCE SA 310123 OISEST 0.1	EUR	50 000 000	50 131 798,33	0,47
BPCE SA 310323 OISEST 0.13	EUR	100 000 000	100 208 095,39	0,95
BPIFRANCE SA 300323 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 945 258,81	0,10
BRED BANQUE POPULAIRE 080323 OISEST 0.12	EUR	50 000 000	50 059 411,92	0,48
BRED BANQUE POPULAIRE 100123 OISEST 0.08	EUR	50 000 000	50 149 520,75	0,47
BRED BANQUE POPULAIRE 120423 OISEST 0.12	EUR	50 000 000	50 048 811,00	0,47
CA CON OISEST+0.25% 05-01-24	EUR	25 000 000	25 096 189,22	0,24
CA OISEST+0.16% 18-01-23	EUR	50 000 000	50 191 844,79	0,47
CA OISEST+0.17% 12-06-23	EUR	50 000 000	50 127 398,61	0,48
CARREFOUR SA 270123 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 976 823,86	0,15
CDC HABITAT 200123 FIX 0.0	EUR	35 000 000	34 959 163,33	0,33
CDC HABITAT 250423 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 794 014,91	0,24
CICOBAIL 110823 FIX 0.0	EUR	3 000 000	2 944 202,52	0,03
COFACE 230123 FIX 0.0	EUR	9 000 000	8 988 096,76	0,08
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 020323 FIX 0	EUR	8 000 000	7 967 970,04	0,08
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 190123 FIX 0.0	EUR	11 000 000	10 987 567,57	0,10
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 280223 FIX 0.0	EUR	2 000 000	1 992 310,35	0,02
CREDIT AGRICOLE CORP IB 010223 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 910 971,72	0,47
CREDIT AGRICOLE SA 020823 OISEST 0.2	EUR	50 000 000	50 075 456,22	0,48
CREDIT AGRICOLE SA 030723 OISEST 0.18	EUR	50 000 000	50 076 978,44	0,48
CREDIT AGRICOLE SA 090323 OISEST 0.09	EUR	50 000 000	50 052 423,96	0,48
CREDIT AGRICOLE SA 130223 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 873 309,33	0,47
CREDIT AGRICOLE SA 210923 OISEST 0.28	EUR	50 000 000	50 214 480,56	0,48
CREDIT AGRICOLE SA 220523 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 487 780,71	0,47
CREDIT LYONNAIS 080223 OISEST 0.08	EUR	50 000 000	50 053 039,69	0,48
CREDIT LYONNAIS 100723 OISEST 0.2	EUR	50 000 000	50 065 206,36	0,48
CREDIT LYONNAIS 160123 OISEST 0.06	EUR	50 000 000	50 063 461,78	0,47
CREDIT LYONNAIS 230523 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 480 866,54	0,47
CRED L OISEST+0.09% 28-02-23	EUR	50 000 000	50 112 916,83	0,48
CRED L OISEST+0.09% 31-01-23	EUR	50 000 000	50 138 884,00	0,47
CRED LYONNAIS OISEST+0.29% 22-09-23	EUR	50 000 000	50 189 721,17	0,47
CRED M OISEST+0.07% 20-03-23	EUR	50 000 000	50 029 845,10	0,47
CRED M OISEST+0.14% 27-03-23	EUR	50 000 000	50 147 172,36	0,48
CRED M OISEST+0.15% 08-06-23	EUR	50 000 000	50 056 728,58	0,48
CRED M OISEST+0.15% 30-05-23	EUR	25 000 000	25 037 504,79	0,24
CRED M OISEST+0.17% 13-07-23	EUR	50 000 000	50 041 612,08	0,47
CRED MUTU ARKE ZCP 03-05-23	EUR	50 000 000	49 575 422,86	0,47
CRED MUTU ARKE ZCP 26-06-23	EUR	50 000 000	49 323 869,49	0,47
DANONE SA 210323 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 950 122,28	0,09
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 050623 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 707 315,02	0,24
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 060223 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 889 338,24	0,47
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 060323 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 896 430,43	0,24
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 120623 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 689 847,51	0,23



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/12/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 130223 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 865 773,80	0,47
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 170123 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 949 376,31	0,47
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 180123 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 973 283,44	0,24
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 230123 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 932 524,52	0,47
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 230223 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 915 199,04	0,24
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 260123 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 924 102,88	0,48
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 280223 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 811 959,85	0,47
ENGIE SA 030123 OISEST 0.08	EUR	25 000 000	25 033 023,78	0,24
ENGIE SA 060323 OISEST 0.1	EUR	50 000 000	50 060 061,11	0,47
ENGIE SA 070323 OISEST 0.1	EUR	25 000 000	25 027 567,40	0,23
ENGIE SA 130323 OISEST 0.1	EUR	25 000 000	25 025 980,50	0,24
ENGIE SA 140223 OISEST 0.11	EUR	50 000 000	50 104 158,86	0,48
ENGIE SA 210223 OISEST 0.1	EUR	25 000 000	25 044 297,38	0,24
ENGIE SA 210323 OISEST 0.08	EUR	25 000 000	25 005 713,19	0,24
ENGIE SA 240123 OISEST 0.13	EUR	40 000 000	40 116 077,44	0,38
ENGIE SA 280223 OISEST 0.1	EUR	100 000 000	100 141 052,50	0,95
ENGIE SA 280223 OISEST 0.1	EUR	50 000 000	50 074 705,11	0,48
GECINA 020223 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 953 718,34	0,23
GECINA 250123 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 965 201,28	0,24
GECINA 300123 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 958 157,72	0,24
HSBC C OISEST+0.3% 29-09-23	EUR	25 000 000	25 111 555,08	0,23
IMERYS 250123 FIX 0.0	EUR	14 500 000	14 476 116,66	0,14
KLEPIERRE 030423 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 882 768,22	0,19
KLEPIERRE 070623 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 886 699,17	0,10
KLEPIERRE 080623 FIX 0.0	EUR	22 000 000	21 748 796,57	0,21
KLEPIERRE 090623 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 827 398,01	0,14
KLEPIERRE 260123 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 978 122,58	0,15
LEGRAND 0.0% 27-04-23	EUR	38 000 000	37 682 814,00	0,36
NATIXIS BAIL 110823 FIX 0.0	EUR	3 000 000	2 944 188,14	0,02
NATIXIS ZCP 20-02-23	EUR	50 000 000	49 845 741,28	0,47
ORAN OISEST+0.08% 16-01-23	EUR	10 000 000	10 029 143,17	0,09
SCHNEIDER ELECTRIC SE 020323 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 921 671,31	0,19
SCHNEIDER ELECTRIC SE 060323 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 937 056,49	0,14
SCHNEIDER ELECTRIC SE 230223 FIX 0.0	EUR	13 000 000	12 955 652,98	0,13
SCHNEIDER ELECTRIC SE 250123 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 962 986,82	0,23
SEB SA 040123 FIX 0.0	EUR	13 000 000	12 996 317,71	0,12
SEB SA 190123 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 971 698,74	0,24
SEB SA 220323 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 895 394,11	0,19
SG OISEST+0.14% 31-03-23	EUR	50 000 000	50 180 887,93	0,48
SG OISEST+0.15% 31-05-23	EUR	50 000 000	50 080 609,58	0,48
SG OISEST+0.22% 15-05-23	EUR	25 000 000	25 096 855,13	0,24
SG OISEST+0.26% 31-05-23	EUR	25 000 000	25 110 908,69	0,23
SG OISEST+0.26% 31-07-23	EUR	50 000 000	50 238 013,79	0,48
SG OISEST+0.31% 26-10-23	EUR	50 000 000	50 194 769,58	0,47
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 170123 FIX 0.	EUR	10 000 000	9 990 311,90	0,09
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 180123 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 989 774,22	0,09
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 190123 FIX 0.0	EUR	11 000 000	10 988 160,26	0,10



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/12/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SOCIETE GENERALE SA 310323 OISEST 0.11	EUR	50 000 000	50 147 699,46	0,47
SODEXO 160123 FIX 0.0	EUR	12 500 000	12 483 300,36	0,12
SODEXO 190123 FIX 0.0	EUR	16 500 000	16 474 072,56	0,16
TECHNIP EUROCASH SNC 210223 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 950 373,44	0,14
TELEPERFORMANCE SE 070323 FIX 0.0	EUR	12 000 000	11 939 802,50	0,11
TELEPERFORMANCE SE 080223 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 985 873,91	0,05
TELEPERFORMANCE SE 100123 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 992 431,01	0,09
TELEPERFORMANCE SE 140223 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 967 074,38	0,10
TELEPERFORMANCE SE 270223 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 978 280,33	0,05
VALEO SA 060123 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 994 923,88	0,09
VALEO SA 190123 FIX 0.0	EUR	9 500 000	9 486 234,95	0,09
VEOLIA ENVIRONNEMENT 060223 FIX 0.0	EUR	42 000 000	41 908 867,07	0,40
VEOLIA ENVIRONNEMENT 230123 FIX 0.0	EUR	39 000 000	38 948 147,03	0,36
VINCI SA 270123 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 961 219,97	0,24
VINCI SA 270323 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 885 959,00	0,19
TOTAL FRANCE			4 409 689 015,77	41,84
IRLANDE				
DXC CAPITAL FUNDING DAC 060123 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 998 344,02	0,04
DXC CAPITAL FUNDING DAC 090123 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 997 043,42	0,05
DXC CAPITAL FUNDING DAC 130223 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 988 374,39	0,04
DXC CAPITAL FUNDING DAC 160223 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 968 532,67	0,10
DXC CAPITAL FUNDING DAC 200223 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 965 237,93	0,09
DXC CAPITAL FUNDING DAC 270223 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 979 612,93	0,04
DXC CAPITAL FUNDING DAC 280223 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 979 170,47	0,04
DXC CAPITAL FUNDING DAC 300123 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 990 693,24	0,05
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 080223 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 932 651,53	0,28
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 300123 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 949 225,41	0,29
TOTAL IRLANDE			107 748 886,01	1,02
ITALIE				
ITAL BUON ORDI DEL ZCP 28-04-23	EUR	50 000 000	49 656 401,56	0,47
ITALY BUONI TES BOT ZCP 310323	EUR	50 000 000	49 756 252,41	0,47
SNAM SPA 230123 FIX 0.0	EUR	67 000 000	66 901 485,33	0,64
UNICREDIT SPA 100223 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 928 104,21	0,28
UNICREDIT SPA 140423 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 652 677,45	0,47
TOTAL ITALIE			245 894 920,96	2,33
LUXEMBOURG				
INTE BANK LUXE ZCP 24-02-23	EUR	50 000 000	49 835 266,76	0,48
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 150223 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 865 317,10	0,47
TOTAL LUXEMBOURG			99 700 583,86	0,95
PAYS-BAS				
AKZO NOBEL NV 120123 FIX 0.0	EUR	39 000 000	38 970 911,46	0,37
AKZO NOBEL NV 140223 FIX 0.0	EUR	14 500 000	14 458 105,95	0,14
AKZO NOBEL NV 310123 FIX 0.0	EUR	14 000 000	13 973 771,54	0,13
AKZO NOBEL NV 310123 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 971 898,08	0,14
EDP FINANCE BV 030223 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 960 069,05	0,19
EDP FINANCE BV 090123 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 988 881,18	0,19
EDP FINANCE BV 100123 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 990 827,49	0,15



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/12/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
EDP FINANCE BV 270123 FIX 0.0	EUR	21 000 000	20 967 343,36	0,19
EDP FINANCE BV 310123 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 992 780,70	0,04
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 020323 FIX 0.0	EUR	21 000 000	20 911 039,56	0,20
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 280223 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 897 670,57	0,24
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 010223 FIX 0.	EUR	50 000 000	49 911 031,09	0,48
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 160523 FIX 0.	EUR	30 000 000	29 720 051,64	0,28
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 220323 FIX 0.	EUR	27 000 000	26 869 582,66	0,25
ING BANK N.V. 171023 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 391 394,86	0,23
STEDIN HOLDING NV 160123 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 993 128,88	0,07
TELEFONICA EUROPE BV 030223 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 934 129,12	0,28
TOTAL PAYS-BAS			375 902 617,19	3,57
ROYAUME-UNI				
DNB BANK ASA 040823 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 589 621,15	0,24
MUFG BANK LTD 230123 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 935 859,05	0,47
RECKITT BENCKI 300523 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 918 783,36	0,06
RECKITT BENCKI 310523 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 707 485,34	0,23
ROYA BANK OF CANA ZCP 15-05-23	EUR	25 000 000	24 784 045,60	0,24
ROYAL BANK OF CANADA 260423 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 786 907,44	0,28
THE TORO BANK LOND ZCP 01-08-23	EUR	25 000 000	24 606 715,11	0,24
THE TORO BANK LOND ZCP 05-12-23	EUR	25 000 000	24 262 494,31	0,23
TOTAL ROYAUME-UNI			209 591 911,36	1,99
SUEDE				
ESSITY AB 200223 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 954 396,40	0,14
ESSITY AB 240223 FIX 0.0	EUR	22 000 000	21 927 109,42	0,21
SKANDINAVISKA ENSKI 280423 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 617 520,59	0,47
SVENSKA HANDELSBANKEN AB 060223 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 903 287,43	0,47
VATTENFALL AB 110423 FIX 0.0	EUR	9 000 000	8 935 172,49	0,09
VATTENFALL AB 130123 FIX 0.0	EUR	14 000 000	13 989 065,21	0,13
VATTENFALL AB 140323 FIX 0.0	EUR	21 000 000	20 897 883,19	0,20
VATTENFALL AB 160123 FIX 0.0	EUR	14 000 000	13 986 724,27	0,13
VATTENFALL AB 250423 FIX 0.0	EUR	35 000 000	34 706 330,46	0,33
TOTAL SUEDE			228 917 489,46	2,17
TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			6 280 871 408,92	59,60
Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ESPAGNE				
CAIXABANK SA 060223 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 987 391,55	0,06
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A. 300123	EUR	50 000 000	49 912 273,49	0,47
TOTAL ESPAGNE			55 899 665,04	0,53
ETATS-UNIS				
DANAHER CORP 120123 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 994 502,61	0,06
TOTAL ETATS-UNIS			6 994 502,61	0,06
FINLANDE				
NORDEA BANK ABP. 020223 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 914 701,88	0,48
TOTAL FINLANDE			49 914 701,88	0,48
IRLANDE				
DXC CAPI FUND ZCP 07-02-23	EUR	4 000 000	3 990 228,00	0,03



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/12/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
DXC CAPITAL FUNDING DAC 160123	EUR	4 000 000	3 995 980,71	0,04
DXC CAPITAL FUNDING DAC 160123 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 995 980,71	0,04
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 280323	EUR	30 000 000	29 827 048,85	0,28
TOTAL IRLANDE			41 809 238,27	0,39
LUXEMBOURG				
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 160323 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 760 810,29	0,47
TOTAL LUXEMBOURG			49 760 810,29	0,47
PAYS-BAS				
BMW FINANCE NV 170123 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 975 773,50	0,24
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 300123 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 950 444,61	0,23
STEDIN HOLDING NV 090123 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 997 689,45	0,04
TOTAL PAYS-BAS			53 923 907,56	0,51
ROYAUME-UNI				
UBS AG 201023 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 356 889,22	0,24
TOTAL ROYAUME-UNI			24 356 889,22	0,24
TOTAL Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé			282 659 714,87	2,68
TOTAL Titres de créances			6 563 531 123,79	62,28
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
OSTRUM SRI CASH A1P1 Part IC	EUR	1 824	210 068 718,57	1,99
OSTRUM SRI CASH Part I	EUR	18 620	200 194 047,20	1,90
OSTRUM SRI CASH PLUS I	EUR	2 973	300 764 199,06	2,86
OSTRUM SRI MONEY PLUS IC	EUR	2 935	300 512 478,10	2,85
TOTAL FRANCE			1 011 539 442,93	9,60
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			1 011 539 442,93	9,60
TOTAL Organismes de placement collectif			1 011 539 442,93	9,60
Instrument financier à terme				
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				
E3R/0.0/FIX/-0.405	EUR	18 000 000	403 678,00	0,00
E3R/0.0/FIX/-0.442	EUR	20 000 000	283 418,89	0,00
E3R/0.0/FIX/-0.46	EUR	4 448 000	63 830,78	0,00
E3R/0.0/FIX/-0.464	EUR	5 399 000	47 920,77	0,00
E3R/0.0/FIX/-0.47	EUR	10 000 000	98 403,33	0,00
E3R/0.0/FIX/-0.495	EUR	10 500 000	183 736,88	0,00
E3R/0.0/FIX/-0.504	EUR	7 800 000	67 617,98	0,01
E3R/0.0/FIX/-0.506	EUR	15 800 000	408 648,57	0,00
E3R/0.0/FIX/-0.511	EUR	18 600 000	192 149,37	0,00
E3R/0.0/FIX/-0.513	EUR	40 000 000	345 922,78	0,00
OISEST/0.0/FIX/0.132	EUR	7 000 000	17 511,86	0,00
OISEST/0.0/FIX/0.447	EUR	50 000 000	147 279,06	0,00
OISEST/0.0/FIX/0.457	EUR	50 000 000	144 673,50	0,00
OISEST/0.0/FIX/0.48	EUR	50 000 000	128 472,92	0,00
OISEST/0.0/FIX/0.48	EUR	15 000 000	33 301,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/0.482	EUR	25 000 000	56 184,31	0,00

● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/12/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OISEST/0.0/FIX/0.486	EUR	50 000 000	120 823,26	0,00
OISEST/0.0/FIX/-0.50	EUR	50 000 000	341 972,57	0,00
OISEST/0.0/FIX/0.508	EUR	50 000 000	118 359,92	0,00
OISEST/0.0/FIX/-0.51	EUR	7 000 000	44 350,59	0,00
OISEST/0.0/FIX/-0.51	EUR	25 000 000	160 684,30	0,00
OISEST/0.0/FIX/-0.51	EUR	28 185 000	262 902,36	0,00
OISEST/0.0/FIX/-0.57	EUR	38 000 000	573 881,30	0,01
OISEST/0.0/FIX/0.61	EUR	50 000 000	135 710,63	0,00
OISEST/0.0/FIX/0.611	EUR	50 000 000	127 956,11	0,01
OISEST/0.0/FIX/0.648	EUR	50 000 000	141 662,75	0,00
OISEST/0.0/FIX/0.72	EUR	25 000 000	299 786,46	0,00
OISEST/0.0/FIX/0.802	EUR	25 000 000	286 519,52	0,00
OISEST/0.0/FIX/0.899	EUR	6 000 000	67 020,73	0,00
OISEST/0.0/FIX/0.922	EUR	25 000 000	271 092,64	0,00
OISEST/0.0/FIX/0.932	EUR	25 000 000	278 320,59	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.202	EUR	25 000 000	27 302,39	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.228	EUR	12 000 000	12 378,12	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.237	EUR	13 000 000	275,80	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.292	EUR	35 000 000	-2 101,94	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.302	EUR	25 000 000	-1 145,84	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.304	EUR	10 000 000	243,78	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.318	EUR	50 000 000	-4 154,87	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.32	EUR	10 000 000	324,15	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.355	EUR	30 000 000	371,61	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.357	EUR	7 000 000	48,98	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.367	EUR	9 000 000	6,30	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.375	EUR	10 000 000	-46,34	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.404	EUR	14 000 000	-235,12	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.430	EUR	10 000 000	-91,58	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.453	EUR	10 000 000	-343,69	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.475	EUR	11 000 000	-619,52	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.478	EUR	9 500 000	-611,04	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.48	EUR	11 000 000	-762,52	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.495	EUR	30 000 000	-400,05	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.534	EUR	4 000 000	-110,44	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.552	EUR	9 000 000	-873,98	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.555	EUR	5 000 000	-999,15	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.557	EUR	9 000 000	-895,35	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.559	EUR	2 500 000	-260,51	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.56	EUR	5 000 000	-535,34	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.57	EUR	10 000 000	-948,50	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.574	EUR	50 000 000	-3 763,75	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.577	EUR	25 000 000	-2 930,84	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.579	EUR	25 000 000	-3 047,50	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.58	EUR	14 000 000	-896,28	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.587	EUR	6 000 000	-115,85	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.594	EUR	15 000 000	-1 385,80	0,00



● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/12/2022 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OISEST/0.0/FIX/1.596	EUR	5 000 000	-319,40	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.597	EUR	2 000 000	-132,18	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.598	EUR	20 000 000	-1 356,51	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.605	EUR	30 000 000	-1 999,35	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.605	EUR	15 000 000	-993,61	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.607	EUR	4 000 000	-286,98	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.609	EUR	25 000 000	-1 034,17	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.613	EUR	2 500 000	-219,12	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.613	EUR	21 000 000	-2 407,54	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.616	EUR	25 000 000	-2 397,37	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.635	EUR	13 500 000	-763,20	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.637	EUR	14 000 000	-840,47	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.645	EUR	20 000 000	-3 106,95	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.645	EUR	99 000 000	-6 570,46	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.665	EUR	15 000 000	-2 599,80	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.667	EUR	4 000 000	-555,47	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.675	EUR	4 000 000	-362,22	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.68	EUR	25 000 000	-2 491,66	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.683	EUR	25 000 000	161 151,52	0,01
OISEST/0.0/FIX/1.683	EUR	4 000 000	-479,51	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.684	EUR	50 000 000	-4 638,41	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.684	EUR	4 000 000	-488,62	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.7	EUR	50 000 000	-8 384,94	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.7	EUR	50 000 000	1 032,38	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.704	EUR	20 000 000	-4 320,50	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.71	EUR	20 000 000	-2 964,27	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.71	EUR	30 000 000	-4 446,40	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.720	EUR	6 000 000	-861,28	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.721	EUR	42 000 000	-6 136,29	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.726	EUR	3 000 000	-53,61	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.727	EUR	10 000 000	-1 416,02	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.737	EUR	22 000 000	-4 432,63	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.743	EUR	5 000 000	-722,87	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.747	EUR	30 000 000	-4 608,90	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.749	EUR	16 000 000	-3 226,80	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.752	EUR	14 500 000	-1 544,69	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.769	EUR	20 000 000	-3 240,13	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.773	EUR	5 000 000	-453,93	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.793	EUR	50 000 000	-4 212,86	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.796	EUR	9 000 000	-740,44	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.8	EUR	2 000 000	-156,86	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.800	EUR	25 000 000	-1 989,67	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.803	EUR	25 000 000	-3 508,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.814	EUR	50 000 000	-2 064,58	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.825	EUR	4 000 000	-206,33	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.829	EUR	11 000 000	-2 118,87	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.847	EUR	12 500 000	-378,23	0,00



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/12/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OISEST/0.0/FIX/1.85	EUR	15 000 000	-1 584,07	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.86	EUR	7 000 000	-209,47	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.86	EUR	5 000 000	-727,19	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.873	EUR	30 000 000	640,65	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.881	EUR	8 000 000	-1 279,73	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.882	EUR	25 000 000	-3 383,19	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.884	EUR	13 000 000	-1 818,30	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.895	EUR	50 000 000	-7 031,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.905	EUR	50 000 000	-2 464,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.905	EUR	50 000 000	-4 772,55	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.913	EUR	16 500 000	-630,77	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.916	EUR	4 000 000	-275,12	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.932	EUR	14 500 000	-845,13	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.94	EUR	50 000 000	-7 261,55	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.946	EUR	10 000 000	-647,29	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.957	EUR	21 000 000	-2 161,55	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.957	EUR	20 000 000	-2 058,62	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.958	EUR	8 000 000	-834,56	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.96	EUR	14 000 000	-1 524,26	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.972	EUR	25 000 000	-5 333,80	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.974	EUR	2 000 000	-436,15	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.974	EUR	21 000 000	-5 474,94	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.986	EUR	8 000 000	-613,89	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.988	EUR	50 000 000	-11 468,47	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.988	EUR	15 000 000	-1 211,66	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.993	EUR	10 000 000	-140,92	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.997	EUR	20 000 000	-598,23	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.998	EUR	8 000 000	-845,78	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.005	EUR	50 000 000	11 231,67	0,01
OISEST/0.0/FIX/2.008	EUR	50 000 000	4 955,25	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.012	EUR	30 000 000	-1 266,17	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.046	EUR	25 000 000	-519,50	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.048	EUR	8 500 000	-1 150,12	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.055	EUR	5 000 000	-77,04	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.062	EUR	25 000 000	-8 960,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.063	EUR	5 000 000	-73,60	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.07	EUR	50 000 000	1 370,44	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.072	EUR	50 000 000	-510,83	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.107	EUR	10 000 000	887,28	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.11	EUR	50 000 000	-4 980,97	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.132	EUR	27 000 000	1 185,18	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.143	EUR	9 000 000	51,01	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.147	EUR	25 000 000	-1 385,20	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.176	EUR	50 000 000	119 221,16	0,01
OISEST/0.0/FIX/2.182	EUR	35 000 000	-5 060,52	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.189	EUR	4 000 000	36,97	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.206	EUR	50 000 000	362,09	0,00



● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/12/2022 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OISEST/0.0/FIX/2.23	EUR	25 000 000	-4 620,57	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.238	EUR	50 000 000	5 903,08	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.273	EUR	50 000 000	388,34	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.281	EUR	25 000 000	6 316,44	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.306	EUR	30 000 000	7 098,94	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.312	EUR	25 000 000	9 605,55	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.330	EUR	15 000 000	8 061,06	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.333	EUR	10 000 000	3 728,32	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.337	EUR	22 000 000	8 879,55	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.348	EUR	7 000 000	-416,33	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.36	EUR	25 000 000	12 130,50	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.408	EUR	25 000 000	49 238,41	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.492	EUR	25 000 000	35 415,07	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.531	EUR	25 000 000	63 666,12	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.576	EUR	25 000 000	84 122,22	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.619	EUR	27 100 000	142 375,81	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.62	EUR	25 000 000	78 098,45	0,00
OISESTR/0/FIX/1.375	EUR	14 000 000	-64,86	0,00
TOTAL Swaps de taux			6 493 672,52	0,06
TOTAL Autres instruments financiers à terme			6 493 672,52	0,06
TOTAL Instrument financier à terme			6 493 672,52	0,06
Créances			0,12	0,00
Dettes			-9 434 481,73	-0,09
Comptes financiers			969 024 802,31	9,20
Actif net			10 538 462 704,68	100,00



NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

43, avenue Pierre Mendès-France - CS 41432 - 75648 Paris cedex 13 France - Tél. : 01 78 40 80 00
Société anonyme au capital de 51 371 060,28 euros
329 450 738 RCS Paris - APE 6630Z - TVA : FR 203 294 507 38