



## NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

OPCVM de droit français

# OSTRUM SRI EURO BONDS 5-7

## RAPPORT SEMESTRIEL

au 30 septembre 2022

**Société de gestion : Natixis Investment Managers International**

**Dépositaire : CACEIS Bank**

**Commissaire aux comptes : Deloitte & Associés**

**• 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	120 488 385,16
b) Avoirs bancaires	227 169,32
c) Autres actifs détenus par l'OPC	18 423 193,71
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	139 138 748,19
e) Passif	-30 606 121,70
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	108 532 626,49

\* 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 EURO BONDS 5-7 Part I en EUR	C	108 341 230,04	23 116,1802	4 686,81
OSTRUM SRI EURO BONDS 5-7 Part R en EUR	C	191 396,45	2 236,0520	85,59



## ● 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.	110,39	86,11
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.	0,62	0,49
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.	0,00	0,00

\* 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	119 517 764,46	110,12	85,90
Franc Suisse	CHF	650 175,27	0,60	0,47
Couronne Norvégienne	NOK	294 032,88	0,27	0,21
Livre Sterling	GBP	26 412,55	0,02	0,02
TOTAL		120 488 385,16	111,02	86,60

\* 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 **
ALLEMAGNE	34,64	27,02
FRANCE	24,81	19,35
ITALIE	18,84	14,70
ESPAGNE	17,18	13,40
BELGIQUE	6,86	5,35
PORTUGAL	3,10	2,42
PAYS-BAS	2,14	1,67
FINLANDE	1,73	1,35
IRLANDE	0,70	0,55
SUISSE	0,60	0,47
NORVEGE	0,27	0,21
LUXEMBOURG	0,12	0,09
ROYAUME-UNI	0,02	0,02
TOTAL	111,02	86,60

\* 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 **
<b>Organismes de placement collectif</b>		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	0,00	0,00
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
<b>Autres actifs</b>		
Autres	0,00	0,00
TOTAL	0,00	0,00

\* 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.	92 236 048,52	66 161 936,42
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.	0,00	0,00
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.	0,00	0,00

**• 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



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

	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

**a) Titres et matières premières prêtés**

Montant	1 027 536,00				
% de l'Actif Net*	0,95%				

\*% hors trésorerie et équivalent de trésorerie

**b) Actifs engagés pour chaque type d'opérations de financement sur titres et TRS exprimés en valeur absolue**

Montant	1 027 536,00	0,00	7 205 253,06	0,00	0,00
% de l'Actif Net	0,95%	0,00	6,64%	0,00	0,00

**c) 10 principaux émetteurs de garanties reçues (hors cash) pour tous les types d'opérations de financement**

VONOVIA SE ALLEMAGNE	2 720 125,33			0,00	0,00
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT FRANCE	2 291 125,58			0,00	0,00
ALLIANZ SE ALLEMAGNE	1 997 097,40			0,00	0,00
MERCEDES-BENZ GROUP AG ALLEMAGNE	1 725 141,90			0,00	0,00
STELLANTIS NV PAYS-BAS	1 386 061,04			0,00	0,00
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN ALLEMAGNE	1 175 135,59			0,00	0,00
SAMPO PLC FINLANDE	963 070,08			0,00	0,00
NEOEN SPA FRANCE	943 388,48			0,00	0,00
STAAT DER NEDERLANDEN PAYS-BAS	938 118,12			0,00	0,00
RENAULT SA FRANCE	749 847,73			0,00	0,00

**d) 10 principales contreparties en valeur absolue des actifs et des passifs sans compensation**

NATIXIS ASSET MANAGEMENT FINANCE FRANCE	1 027 536,00	0,00	7 205 253,06	0,00	0,00
---	--------------	------	--------------	------	------





	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

**e) Type et qualité des garanties (collatéral)**

Type					
- Actions	15 505 471,81			0,00	0,00
- Obligations	5 200 117,38			0,00	0,00
- OPC	0,00			0,00	0,00
- TCN	0,00			0,00	0,00
- Cash	0,00		7 644 968,14		0,00
<b>Rating</b>	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

Monnaie de la garantie					
Livre Sterling	26 412,55		7 644 968,14	0,00	0,00
Franc Suisse	650 175,27		7 644 968,14	0,00	0,00
Euro	19 734 968,49		7 644 968,14	0,00	0,00
Couronne Norvégienne	294 032,88		7 644 968,14	0,00	0,00

**f) Règlement et compensation des contrats**

Triparties				X	
Contrepartie centrale					
Bilatéraux	X			X	

**g) Échéance de la garantie ventilée en fonction des tranches**

Moins d'1 jour	0,00			0,00	0,00
1 jour à 1 semaine	0,00			0,00	0,00
1 semaine à 1 mois	0,00			0,00	0,00
1 à 3 mois	0,00			0,00	0,00
3 mois à 1 an	1 906 701,70			0,00	0,00
Plus d'1 an	2 881 541,20			0,00	0,00
Ouvertes	15 917 346,29			0,00	0,00



	Prêts de titres	Emprunts de titres	Mise en pension	Prise en pension	TRS
--	-----------------	--------------------	-----------------	------------------	-----

#### h) Échéance des opérations de financement sur titres et TRS ventilée en fonction des tranches

Moins d'1 jour	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
1 jour à 1 semaine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
1 semaine à 1 mois	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
1 à 3 mois	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
3 mois à 1 an	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Plus d'1 an	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Ouvertes	1 027 536,00	0,00	7 205 253,06	0,00	0,00

#### i) Données sur la réutilisation des garanties

Montant maximal (%)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Montant utilisé (%)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Revenus pour l'OPC suite au réinvestissement des garanties espèces en euros	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

#### j) Données sur la conservation des garanties reçues par l'OPC

CACEIS Bank					
Titres	20 705 589,19			0,00	0,00
Cash	0,00				0,00

#### k) Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC

Titres	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Cash	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

#### l) Données sur les revenus et les coûts ventilés

<b>Revenus</b>					
- OPC	109,78	0,00	-5 698,65	45 109,26	
- Gestionnaire	0,00	0,00	0,00	0,00	
- Tiers	0,00	0,00	0,00	0,00	
<b>Coûts</b>					
- OPC	1 217,77	0,00	0,00	939,55	
- Gestionnaire	0,00	0,00	0,00	0,00	
- Tiers	0,00	0,00	0,00	0,00	



#### **e) Données Type et qualité des garanties (collatéral)**

Le collatéral reçu doit être conforme à la politique de NIM International définie afin de garantir un haut niveau de qualité et de liquidité ainsi qu'une absence de corrélation directe avec la contrepartie de l'opération. En complément, la politique de collatéralisation de NIM International définit des niveaux de sur-collatéralisation adaptés à chaque type de titres pour faire face le cas échéant à la variation de leur valeur. Enfin un dispositif d'appel de marges quotidien est en place afin de compenser les variations de mark to market des titres.

#### **i) Données sur la réutilisation des garanties**

Les OPCVM doivent impérativement réinvestir l'intégralité de leurs garanties cash (ie. montant maximal = montant maximal utilisé = 100%), mais ne peuvent réutiliser leurs garanties titres (ie. montant maximal = montant utilisé = 0%).

Par ailleurs, en cas de réception de garanties financières en espèces, celles-ci doivent, dans des conditions fixées par la réglementation, uniquement être :

- placées en dépôts ;
- investies dans des obligations d'Etat de haute qualité ;
- utilisées dans une prise en pension livrée ;
- investies dans des organismes de placement collectif (OPC) monétaire court terme.

Pour les opérations réalisées par Natixis TradEx Solutions, en mode agent ou en mode principal, les sommes reçues au titre du collatéral espèces sur les opérations de cessions temporaires de titres sont investies sur un compte de dépôts rémunéré.

#### **k) Données sur la conservation des garanties fournies par l'OPC**

Toutes les garanties financières fournies par l'OPC sont transférées en pleine propriété.

#### **l) Données sur les revenus et les coûts ventilés**

La société de gestion a confié à Natixis TradEx Solutions pour le compte de l'OPCVM la réalisation des opérations de prêts de titres et de mises en pension.

Les revenus de ces opérations sont restitués à l'OPCVM. Ces opérations engendrent des coûts qui sont supportés par l'OPCVM. La facturation de Natixis TradEx Solutions ne peut excéder 40% des revenus générés par ces opérations et est déduite des produits comptabilisés par l'OPCVM.

Les montants présentés n'intègrent pas la rémunération du placement en compte de dépôt des garanties financières reçues en espèces.



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/09/2022 EN EUR**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Dépôts</b>				
Collat. especes p/e	EUR	7 256 227,36	7 252 843,96	6,68
<b>TOTAL Dépôts</b>			<b>7 252 843,96</b>	<b>6,68</b>
<b>Obligations et valeurs assimilées</b>				
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
ALLEMAGNE 0.1% 15-04-26 IND	EUR	366 042,58	440 669,51	0,40
BUNDSOBLIGATION 1.3% 15-10-27	EUR	4 000 000	3 892 454,25	3,59
DBR 0 08/15/30	EUR	22 350 000	19 137 858,00	17,63
KFW 0.0% 15-12-27 EMTN	EUR	2 300 000	2 014 386,00	1,86
KFW 0.0% 31-03-27 EMTN	EUR	2 100 000	1 877 232,00	1,73
KFW 0.625% 07-01-28	EUR	1 100 000	1 000 112,62	0,92
LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK 0.0% 13-12-28	EUR	1 400 000	1 182 342,00	1,09
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>29 545 054,38</b>	<b>27,22</b>
<b>BELGIQUE</b>				
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.0% 22-10-27	EUR	750 000	668 287,50	0,62
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 22-06-27	EUR	4 540 000	4 263 284,51	3,93
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 22-06-28	EUR	100 000	92 095,95	0,08
EUROPEAN UNION 0.0% 02-06-28	EUR	2 800 000	2 409 596,00	2,22
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>7 433 263,96</b>	<b>6,85</b>
<b>ESPAGNE</b>				
SPAIN GOVERNMENT BOND 0.0% 31-01-28	EUR	2 000 000	1 732 440,00	1,59
SPAIN GOVERNMENT BOND 1.4% 30-07-28	EUR	5 800 000	5 385 192,74	4,97
SPAIN GOVERNMENT BOND 1.45% 31-10-27	EUR	8 100 000	7 752 731,92	7,14
SPAIN GOVERNMENT BOND 1.5% 30-04-27	EUR	3 750 000	3 601 770,21	3,32
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>18 472 134,87</b>	<b>17,02</b>
<b>FINLANDE</b>				
FINLAND GOVERNEMENT BOND 0.5% 15-09-27	EUR	1 000 000	914 690,27	0,84
<b>TOTAL FINLANDE</b>			<b>914 690,27</b>	<b>0,84</b>
<b>FRANCE</b>				
BPIFRANCE 0.0% 25-05-28 EMTN	EUR	2 200 000	1 901 240,00	1,75
CADES 0.0% 25-02-28	EUR	1 600 000	1 388 176,00	1,28
CADES 0.0% 25-11-26 EMTN	EUR	800 000	723 056,00	0,67
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.75% 25-05-28	EUR	4 000 000	3 679 089,32	3,39
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.75% 25-11-28	EUR	4 800 000	4 396 327,23	4,05
OATE 1,85%11-25072027 INDX	EUR	2 500 000	3 420 703,58	3,15
UNEDIC 1 1/4 03/28/27	EUR	3 500 000	3 335 488,97	3,07
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>18 844 081,10</b>	<b>17,36</b>
<b>IRLANDE</b>				
IRELAND GOVERNMENT BOND 0.2% 15-05-27	EUR	830 000	758 618,41	0,70
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>758 618,41</b>	<b>0,70</b>
<b>ITALIE</b>				
ITALIE 6,50%97-27 TBO	EUR	2 429 999	2 818 372,01	2,60
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.95% 15-09-27	EUR	3 950 000	3 465 369,04	3,20
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.45% 15-11-24	EUR	2 700 000	2 635 969,79	2,43
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.0% 01-02-28	EUR	2 400 000	2 205 643,83	2,03
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.2% 01-06-27	EUR	6 000 000	5 681 481,97	5,23



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/09/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.8% 15-06-29	EUR	3 900 000	3 645 961,03	3,36
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>20 452 797,67</b>	<b>18,85</b>
<b>PORTUGAL</b>				
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 0.7% 15-10-27	EUR	600 000	552 455,42	0,51
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 1.95% 15-06-29	EUR	1 500 000	1 439 985,21	1,32
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 2.125% 17-10-28	EUR	500 000	495 681,58	0,46
PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 4.125% 14-04-27	EUR	800 000	874 033,10	0,81
<b>TOTAL PORTUGAL</b>			<b>3 362 155,31</b>	<b>3,10</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>99 782 795,97</b>	<b>91,94</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées</b>			<b>99 782 795,97</b>	<b>91,94</b>
<b>Titres reçus en garantie</b>				
<b>Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
ADIDAS NOM.	EUR	87	10 342,56	0,01
AIR LIQUIDE	EUR	1 138	133 783,28	0,12
ALLIANZ SE-REG	EUR	12 343	1 997 097,40	1,84
AMADEUS IT GROUP SA	EUR	558	26 733,78	0,03
ARKEMA	EUR	3 769	282 976,52	0,26
EDENRED	EUR	236	11 176,96	0,01
EDF	EUR	38 114	453 175,46	0,42
EIFFAGE	EUR	5 661	467 145,72	0,43
ENGIE	EUR	14 641	173 378,72	0,16
GECINA NOMINATIVE	EUR	8 154	655 989,30	0,60
HERMES INTERNATIONAL	EUR	109	132 653,00	0,13
IPSEN	EUR	1 347	127 830,30	0,11
LEGRAND SA	EUR	1 400	93 324,00	0,09
MERCEDES BENZ GROUP AG REGISTERED SHARES	EUR	32 954	1 725 141,90	1,59
NEOEN SA	EUR	27 472	943 388,48	0,87
NOVARTIS AG-REG	CHF	8 300	650 175,27	0,60
ORKLA ASA	NOK	25 279	187 541,27	0,17
RED ELECTRICA DE ESPANA	EUR	9 351	146 904,21	0,14
RENAULT SA	EUR	26 809	749 847,73	0,69
SAINT-GOBAIN	EUR	1 300	48 165,00	0,05
SALMAR ASA	NOK	3 096	106 491,61	0,10
SAMPO OYJ A	EUR	22 008	963 070,08	0,89
SCHNEIDER ELECTRIC SA	EUR	692	80 922,48	0,07
SR TELEPERFORMANCE	EUR	168	43 831,20	0,04
STELLANTIS NV	EUR	112 945	1 386 061,04	1,28
THALES	EUR	3 322	375 386,00	0,34
VINCI (EX SGE)	EUR	6 730	559 734,10	0,52
VIVENDI	EUR	31 746	253 079,11	0,23
VONOVIA SE	EUR	122 473	2 720 125,33	2,50
<b>TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>15 505 471,81</b>	<b>14,29</b>
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
ALLEMAGNE 6.25%94-24	EUR	381 526	421 245,37	0,38
BANQUE EUROPEAN D INVESTISSEMENT 0.0% 22-12-26	EUR	145 000	130 030,20	0,12



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/09/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BELGIQUE 3.75% 22/06/2045	EUR	12 694	14 088,50	0,02
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 0.2% 14-06-24	EUR	1 203 420,59	1 175 135,59	1,08
EMPRUNT ETAT 5,75%01-32 OAT	EUR	10 138	13 362,10	0,01
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 5.5% 25-04-29	EUR	317 984	384 423,88	0,35
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT ZCP 25-03-23	EUR	1 917 208	1 906 701,70	1,76
ROYA DES PAYS 0.25% 15-07-25	EUR	979 579	938 118,12	0,87
TSY IL GILT 2.5% 17-07-24 IND	GBP	6 304,92	26 412,55	0,02
UNEDIC 1 1/4 03/28/27	EUR	200 000	190 599,37	0,18
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>5 200 117,38</b>	<b>4,79</b>
<b>TOTAL Titres reçus en garantie</b>			<b>20 705 589,19</b>	<b>19,08</b>
<b>Dettes représentatives des titres reçus en garantie</b>			<b>-20 705 589,19</b>	<b>-19,08</b>
<b>Créance représentative de titres prêtés</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
DBR 0 08/15/30	EUR	1 200 000	1 027 536,00	0,95
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>1 027 536,00</b>	<b>0,95</b>
<b>TOTAL Créance représentative de titres prêtés</b>			<b>1 027 536,00</b>	<b>0,95</b>
<b>Indemnités sur titres prêtés</b>			32,66	0,00
<b>Titres donnés en pension</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
ALLEMAGNE 0.1% 15-04-26 IND	EUR	2 033 957,42	2 448 630,48	2,26
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>2 448 630,48</b>	<b>2,26</b>
<b>BELGIQUE</b>				
BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.8% 22-06-28	EUR	2 000 000	1 841 918,90	1,70
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>1 841 918,90</b>	<b>1,70</b>
<b>FRANCE</b>				
CADES 0.0% 25-11-26 EMTN	EUR	1 300 000	1 174 966,00	1,08
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>1 174 966,00</b>	<b>1,08</b>
<b>ITALIE</b>				
ITALIE 6,50%97-27 TBO	EUR	1 500 001	1 739 737,68	1,60
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>1 739 737,68</b>	<b>1,60</b>
<b>TOTAL Titres donnés en pension</b>			<b>7 205 253,06</b>	<b>6,64</b>
<b>Dettes représentatives des titres données en pension</b>			<b>-7 643 152,72</b>	<b>-7,05</b>
<b>Indemnités sur titres données en pension</b>			-1 815,42	0,00
<b>Instrument financier à terme</b>				
<b>Engagements à terme fermes</b>				
<b>Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé</b>				
EURO BOBL 1222	EUR	-74	275 280,00	0,25
EURO SCHATZ 1222	EUR	-299	-83 825,00	-0,08
EUR SHORT EUR-B 1222	EUR	-92	-50 110,00	-0,04
FGBL BUND 10A 1222	EUR	50	-116 370,00	-0,11
XEUR FOAT EUR 1222	EUR	22	6 746,67	0,01
<b>TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé</b>			<b>31 721,67</b>	<b>0,03</b>
<b>TOTAL Engagements à terme fermes</b>			<b>31 721,67</b>	<b>0,03</b>
<b>TOTAL Instrument financier à terme</b>			<b>31 721,67</b>	<b>0,03</b>
<b>Appel de marge</b>				
APPEL MARGE CACEIS	EUR	-31 721,6	-31 721,60	-0,03



- **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/09/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>TOTAL Appel de marge</b>			<b>-31 721,60</b>	<b>-0,03</b>
<b>Créances</b>			<b>2 655 501,36</b>	<b>2,45</b>
<b>Dettes</b>			<b>-1 973 537,77</b>	<b>-1,82</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>227 169,32</b>	<b>0,21</b>
<b>Actif net</b>			<b>108 532 626,49</b>	<b>100,00</b>



**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