



NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

OPCVM de droit français

OSTRUM SRI MONEY 6M

RAPPORT SEMESTRIEL

au 30 mars 2023

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	1 012 585 160,07
b) Avoirs bancaires	92 307 169,03
c) Autres actifs détenus par l'OPC	106 224 213,70
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	1 211 116 542,80
e) Passif	-1 655 986,58
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	1 209 460 556,22

* 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 6M E en EUR	C	27 467 049,89	2 671,50061	10 281,50
OSTRUM SRI MONEY 6M I en EUR	C	1 181 993 506,33	113 416,49458	10 421,70

**● ÉLÉMENTS 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.	73,49	73,39
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.	10,23	10,22
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.	8,69	8,68

* 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	1 012 585 160,07	83,72	83,61
TOTAL		1 012 585 160,07	83,72	83,61

* 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	47,26	47,20
PAYS-BAS	10,77	10,75
LUXEMBOURG	6,34	6,33
ESPAGNE	5,21	5,20
CANADA	4,46	4,45
ROYAUME-UNI	3,26	3,26
IRLANDE	2,06	2,06
ETATS-UNIS	1,68	1,68
BELGIQUE	1,24	1,24
ALLEMAGNE	0,89	0,89
ITALIE	0,39	0,39
SUEDE	0,17	0,16
TOTAL	83,72	83,61

* 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	8,69	8,68
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	8,69	8,68

* 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.	3 992 813 816,60	4 061 538 981,65
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.	220 902 234,11	216 676 795,00
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.	297 374 929,80	269 572 175,23

• 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

	30/03/2023
Part OSTRUM SRI MONEY 6M E	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Part OSTRUM SRI MONEY 6M I	
Frais de gestion variables provisionnés	195 406,58
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,03
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)**

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

a) Titres et matières premières prêtés

Montant	0,00				
% de l'Actif Net*	0,00				

*% 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	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
% de l'Actif Net	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

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

	0,00			0,00	0,00
--	------	--	--	------	------

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

	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
--	------	------	------	------	------

e) Type et qualité des garanties (collatéral)

Type					
- Actions	0,00			0,00	0,00
- Obligations	0,00			0,00	0,00
- OPC	0,00			0,00	0,00
- TCN	0,00			0,00	0,00
- Cash	1 185 497,97		0,00		0,00
Rating	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

Monnaie de la garantie					
Euro	1 185 497,97		0,00	0,00	0,00

f) Règlement et compensation des contrats

Triparties				X	
Contrepartie centrale					
Bilatéraux	X			X	



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

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	0,00			0,00	0,00
Plus d'1 an	0,00			0,00	0,00
Ouvertes	0,00			0,00	0,00

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	0,00	0,00	0,00	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 FRANCE					
Titres	0,00			0,00	0,00
Cash	1 185 497,97				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



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

l) Données sur les revenus et les coûts ventilés

Revenus					
- OPC	0,00	0,00	0,00	0,00	
- Gestionnaire	0,00	0,00	0,00	0,00	
- Tiers	0,00	0,00	0,00	0,00	
Coûts					
- OPC	22 079,40	0,00	0,00	0,00	
- 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.



I) 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 30/03/2023 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				
CANADA				
BANK OF NOVA SCOTIA TORONTO E3R+0.75% 06-09-23	EUR	5 000 000	5 024 379,44	0,42
CAN IMP BK E3R+0.47% 24-01-25	EUR	10 000 000	10 073 634,17	0,83
CAN IMP BK E3R+0.75% 26-01-24	EUR	1 000 000	1 009 680,47	0,08
NATL BANK OF CANADA E3R+0.75% 01-02-24	EUR	1 000 000	1 008 766,44	0,09
ROYAL BANK OF CANADA 0.25% 02-05-24	EUR	2 000 000	1 934 322,74	0,16
ROYAL BANK OF CANADA E3R+0.43% 17-01-25	EUR	15 000 000	15 108 786,67	1,25
TORONTO DOMINION BANK THE E3R+0.45% 20-01-25	EUR	4 800 000	4 836 967,47	0,40
TOTAL CANADA			38 996 537,40	3,23
ESPAGNE				
BANCO NTANDER E3R+0.55% 16-01-25	EUR	10 100 000	10 178 175,68	0,85
BANCO NTANDER E3R+1.0% 05-05-24	EUR	8 100 000	8 197 821,00	0,68
BBVA E3R+0.7% 11-07-24 EMTN	EUR	10 000 000	10 091 250,00	0,83
BBVA E3R+1.0% 09-09-23 EMTN	EUR	500 000	503 066,11	0,03
IBERDROLA FINANZAS SAU E3R+0.65% 04-12-23	EUR	6 000 000	6 024 684,67	0,49
IBERDROLA FINANZAS SAU E3R+0.65% 28-04-23	EUR	20 000 000	20 123 870,00	1,67
TOTAL ESPAGNE			55 118 867,46	4,55
ETATS-UNIS				
ATT E3R+0.4% 06-03-25	EUR	6 200 000	6 225 913,93	0,52
FIDELITY NATL INFORMATION SCES 0.75% 21-05-23	EUR	9 570 000	9 602 764,80	0,79
TOTAL ETATS-UNIS			15 828 678,73	1,31
FRANCE				
ACAFP 3.39 10/18/23	EUR	1 000 000	1 007 302,50	0,09
ALD 0.375% 18-07-23 EMTN	EUR	10 000 000	9 945 009,59	0,82
ALD E3R+0.55% 21-02-25 EMTN	EUR	5 400 000	5 431 718,55	0,45
BNFP 2.6 06/28/23	EUR	1 000 000	1 019 473,97	0,08
BPCE E3R+0.33% 06-09-24 EMTN	EUR	5 000 000	4 995 726,11	0,41
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN E3R+0.2% 18-07-24	EUR	500 000	503 034,58	0,04
SG E3R+0.45% 13-01-25 EMTN	EUR	15 500 000	15 597 908,33	1,29
VILOGIA STE ANONYME D HLM E3R+0.75% 27-07-23	EUR	6 000 000	6 033 428,00	0,50
TOTAL FRANCE			44 533 601,63	3,68
IRLANDE				
FCA BANK E3R+1.6% 24-03-24	EUR	6 000 000	6 038 450,00	0,50
TOTAL IRLANDE			6 038 450,00	0,50
ITALIE				
INTE E3R+0.63% 17-03-25 EMTN	EUR	4 000 000	4 002 987,22	0,32
TRASMISSIONE ELETTRICITA RETE NAZIONALE 1.0% 23-07-23	EUR	700 000	700 328,23	0,06
TOTAL ITALIE			4 703 315,45	0,38
LUXEMBOURG				
HIGHLAND HOLDINGS SARL 0.0000010% 12-11-23	EUR	12 100 000	11 831 259,00	0,98
TRATON FINANCE LUXEMBOURG E3RJ+0.85% 17-02-24	EUR	10 000 000	10 026 250,00	0,83
TOTAL LUXEMBOURG			21 857 509,00	1,81



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/03/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
PAYS-BAS				
DAIMLER TRUCK INTL FI E3R+0.7% 06-10-23	EUR	14 000 000	14 132 941,67	1,17
DE VOLKSBANK NV E3R+0.55% 12-09-24	EUR	5 000 000	5 022 652,50	0,42
EDP FIN 1.875% 29-09-23 EMTN	EUR	2 500 000	2 507 361,99	0,20
HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV E3R+0.55% 19-01-24	EUR	15 600 000	15 327 316,33	1,27
THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE I BV E3R+0.2% 18-11-23	EUR	20 800 000	20 851 960,71	1,73
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV E3R+0.7% 17-01-24	EUR	16 500 000	16 610 260,33	1,37
TOTAL PAYS-BAS			74 452 493,53	6,16
ROYAUME-UNI				
HSBC BK E3R+0.4% 08-03-25 EMTN	EUR	5 000 000	5 016 026,39	0,42
TOTAL ROYAUME-UNI			5 016 026,39	0,42
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			266 545 479,59	22,04
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			266 545 479,59	22,04
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 140423 FIX 0.0	EUR	1 000 000	998 826,27	0,08
SANTANDER CONSUMER BANK AG 021123 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 898 616,28	0,40
SANTANDER CONSUMER BANK AG 030124 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 867 407,39	0,41
TOTAL ALLEMAGNE			10 764 849,94	0,89
BELGIQUE				
COFINIMMO SA 240423 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 968 203,54	1,24
TOTAL BELGIQUE			14 968 203,54	1,24
CANADA				
Bank of Montreal 071123 OISEST 0.4	EUR	5 000 000	5 055 551,34	0,42
ROYAL BANK OF CANADA 100823 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 943 558,08	0,41
TORONTO DOMINION BANK, THE 110823 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 941 720,29	0,41
TOTAL CANADA			14 940 829,71	1,24
ESPAGNE				
ENDESA SA 250423 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 989 700,43	0,41
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A. 120324 FIX 0.0	EUR	3 000 000	2 898 011,59	0,24
TOTAL ESPAGNE			7 887 712,02	0,65
ETATS-UNIS				
FIDELITY NATIO 310323 FIX 0.0	EUR	2 500 000	2 500 000,00	0,21
NATIONAL GRID NORTH AMERICA 260423 FIX 0.0	EUR	2 000 000	1 995 625,84	0,16
TOTAL ETATS-UNIS			4 495 625,84	0,37
FRANCE				
ALSTOM SA 250923 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 919 578,07	0,41
ARKEMA 080923 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 782 378,83	1,22
BFCM (BANQUE FEDER 100723 OISEST 0.28)	EUR	20 000 000	20 161 655,38	1,67
BFCM (BANQUE FEDER 110923 OISEST 0.18)	EUR	15 000 000	15 042 704,55	1,25
BFCM (BANQUE FEDER 230523 OISEST 0.21)	EUR	10 000 000	10 082 504,00	0,83
BNP PA OISEST+0.16% 04-07-23	EUR	10 000 000	10 062 929,04	0,84
BONDUELLE 020523 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 986 478,89	0,41
BPCE SA 030124 OISEST 0.35	EUR	20 000 000	20 140 673,55	1,67
BPCE SA 080923 OISEST 0.18	EUR	15 000 000	15 027 559,45	1,24
BPCE SA 180923 OISEST 0.21	EUR	15 000 000	15 051 367,09	1,25



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/03/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CA CON OISEST+0.265% 01-12-23	EUR	15 000 000	15 121 535,50	1,25
CA OISEST+0.28% 29-08-23	EUR	10 000 000	10 112 287,73	0,84
CASA C OISEST+0.28% 08-09-23	EUR	14 000 000	14 156 106,65	1,17
CFCM - COMPAGN 151123 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 577 369,56	1,61
CFCM - COMPAGNIE F 041223 OISEST 0.21	EUR	5 000 000	5 011 395,34	0,41
CFCM - COMPAGNIE F 240423 OISEST 0.14	EUR	5 000 000	5 039 258,51	0,42
COFACE 070923 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 926 032,88	0,41
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 110423 FIX 0	EUR	3 000 000	2 997 292,78	0,25
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 190423 FIX 0.0	EUR	2 000 000	1 996 884,43	0,16
CREDIT AGRICOLE SA 060324 OISEST 0.32	EUR	15 000 000	15 031 340,30	1,24
CREDIT AGRICOLE SA 100723 OISEST 0.16	EUR	20 000 000	20 112 059,56	1,66
CREDIT AGRICOLE SA 131223 OISEST 0.29	EUR	10 000 000	10 039 789,58	0,83
CREDIT LYONNAIS 051223 OISEST 0.31	EUR	10 000 000	10 083 863,08	0,83
CREDIT LYONNAIS 140224 OISEST 0.33	EUR	5 000 000	5 018 864,94	0,41
CRED M OISEST+0.28% 05-12-23	EUR	20 000 000	20 163 732,82	1,67
DIAC 110523 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 965 087,81	0,82
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 170124 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 581 977,01	1,20
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 180723 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 857 527,09	1,23
ENGIE SA 140423 OISEST 0.1	EUR	10 000 000	10 032 685,25	0,83
KLEPIERRE 030423 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 998 723,03	0,41
KLEPIERRE 080623 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 969 989,88	0,41
KLEPIERRE 140324 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 672 155,93	0,80
KLEPIERRE 180923 FIX 0.0	EUR	3 000 000	2 953 726,99	0,24
KLEPIERRE 250923 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 838 519,56	0,82
LA BANQUE POSTALE 060723 OISEST 0.15	EUR	10 000 000	10 074 254,67	0,84
LEGRAND 0.0% 27-04-23	EUR	20 000 000	19 954 120,00	1,65
NATIXIS 210224 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 381 028,11	1,61
NATIXIS 271023 OISEST 0.25	EUR	20 000 000	20 095 673,10	1,66
NEXITY ZCP 03-04-23	EUR	14 000 000	13 995 764,30	1,15
PSA BA E3R+0.35% 16-06-23	EUR	15 000 000	15 043 648,75	1,25
RCI BANQUE 170723 FIX 0.0	EUR	2 000 000	1 980 549,42	0,16
SCHNEIDER ELECTRIC SE 060423 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 997 582,75	0,41
SCHNEIDER ELECTRIC SE 220623 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 965 321,11	0,41
SG OISEST+0.22% 15-05-23	EUR	10 000 000	10 099 397,52	0,83
SG OISEST+0.31% 26-10-23	EUR	10 000 000	10 104 866,27	0,84
SG OISEST+0.37% 31-01-24	EUR	10 000 000	10 059 789,63	0,83
VALEO SA 020523 FIX 0.0	EUR	3 000 000	2 991 015,52	0,25
VALEO SA 150523 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 978 712,27	0,41
VALEO SA 190423 FIX 0.0	EUR	1 500 000	1 497 339,90	0,12
VALEO SA 220523 FIX 0.0	EUR	500 000	497 525,84	0,04
VEOLIA ENVIRONNEMENT 210224 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 845 184,52	0,40
TOTAL FRANCE			527 077 808,74	43,57
IRLANDE				
DXC CAPITAL FUNDING DAC 110423 FIX 0.0	EUR	1 000 000	999 058,52	0,09
DXC CAPITAL FUNDING DAC 240423 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 989 739,43	0,41
JOHNSON CONT 150623 FIX 0.0	EUR	8 000 000	7 946 418,19	0,66
TOTAL IRLANDE			13 935 216,14	1,16



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/03/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
LUXEMBOURG				
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 150923 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 846 828,64	0,81
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 240823 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 869 371,85	0,82
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 250124 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 712 706,24	0,81
ITT INDUSTRIES LUXEMBOURG SARL 120423 FI	EUR	5 500 000	5 494 104,28	0,45
ITT INDUSTRIES LUXEMBOURG SARL 140423 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 987 496,54	0,82
TOTAL LUXEMBOURG			44 910 507,55	3,71
PAYS-BAS				
AKZO NOBEL NV 140623 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 974 294,59	0,33
AKZO NOBEL NV 310323 FIX 0.0	EUR	2 000 000	2 000 000,00	0,17
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 210623 FIX	EUR	10 000 000	9 928 673,57	0,82
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 280423 FIX 0.0	EUR	3 000 000	2 993 053,22	0,25
HEINEKEN NV 220623 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 950 092,20	0,58
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 020523 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 973 667,74	0,82
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 160523 FIX 0.	EUR	10 000 000	9 961 404,76	0,82
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 280423 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 977 088,72	0,82
TOTAL PAYS-BAS			55 758 274,80	4,61
ROYAUME-UNI				
AMCOR UK FINANCE PLC 040523 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 985 478,02	0,41
AMCOR UK FINANCE PLC 050523 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 985 032,37	0,41
AMCOR UK FINANCE PLC 170723 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 902 438,21	0,82
BARCLAYS BANK PLC 250124 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 857 457,90	0,40
THE TORO BANK LOND ZCP 05-12-23	EUR	5 000 000	4 887 093,24	0,41
UBS AG LONDON 260324 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 824 378,91	0,40
TOTAL ROYAUME-UNI			34 441 878,65	2,85
SUEDE				
VATTENFALL AB 110423 FIX 0.0	EUR	2 000 000	1 998 187,01	0,16
TOTAL SUEDE			1 998 187,01	0,16
TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			731 179 093,94	60,45
Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
IRLANDE				
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 120523 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 982 351,35	0,41
TOTAL IRLANDE			4 982 351,35	0,41
LUXEMBOURG				
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 150823 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 878 235,19	0,82
TOTAL LUXEMBOURG			9 878 235,19	0,82
TOTAL Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé			14 860 586,54	1,23
TOTAL Titres de créances			746 039 680,48	61,68
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
OSTRUM SRI CASH Part M	EUR	5 280,91025	52 206 128,17	4,32
OSTRUM SRI CASH PLUS I	EUR	519,9768	52 904 566,34	4,37
TOTAL FRANCE			105 110 694,51	8,69
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			105 110 694,51	8,69
TOTAL Organismes de placement collectif			105 110 694,51	8,69



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/03/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Instrument financier à terme				
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				
E3R/0.0/FIX/-0.39	EUR	12 100 000	326 330,95	0,02
E3R/0.0/FIX/-0.427	EUR	1 000 000	26 269,75	0,01
E3R/0.0/FIX/-0.448	EUR	1 000 000	12 202,97	0,00
E3R/0.0/FIX/-0.450	EUR	700 000	12 752,28	0,00
E3R/0.0/FIX/-0.475	EUR	8 400 000	95 851,23	0,01
E3R/0.0/FIX/2.438	EUR	4 000 000	791,44	0,00
FIX/2.4845/E3R/0.0	EUR	8 400 000	15 498,58	0,01
FIX/3.094/OISEST/0.0	EUR	3 400 000	-4 510,14	0,00
OISEST/0.0/FIX/-0.57	EUR	20 000 000	307 193,56	0,03
OISEST/0.0/FIX/0.922	EUR	5 000 000	54 483,21	0,00
OISEST/0.0/FIX/0.924	EUR	5 000 000	54 848,95	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.062	EUR	5 000 000	26 818,58	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.646	EUR	15 000 000	94 617,50	0,01
OISEST/0.0/FIX/1.769	EUR	5 000 000	-328,12	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.797	EUR	2 000 000	518,03	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.143	EUR	2 000 000	291,68	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.193	EUR	5 000 000	4 188,70	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.233	EUR	5 000 000	-134,06	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.306	EUR	10 000 000	4 137,96	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.332	EUR	1 000 000	62,34	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.337	EUR	3 000 000	217,28	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.337	EUR	5 000 000	2 838,34	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.406	EUR	2 000 000	48,82	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.416	EUR	5 000 000	1 341,68	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.425	EUR	2 000 000	140,56	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.427	EUR	1 500 000	98,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.437	EUR	3 000 000	219,94	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.470	EUR	10 000 000	1 116,64	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.494	EUR	5 000 000	367,38	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.531	EUR	5 000 000	11 072,83	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.537	EUR	10 000 000	640,16	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.545	EUR	2 500 000	28,55	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.575	EUR	10 000 000	451,47	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.576	EUR	5 000 000	14 749,87	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.590	EUR	5 000 000	57,67	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.592	EUR	5 000 000	103,77	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.595	EUR	9 000 000	70,20	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.598	EUR	1 000 000	4,03	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.619	EUR	3 400 000	20 378,41	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.638	EUR	5 000 000	48,43	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.663	EUR	5 500 000	326,44	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.681	EUR	5 000 000	-57,65	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.707	EUR	5 000 000	-64,25	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.774	EUR	15 000 000	-480,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.776	EUR	4 570 000	-233,30	0,00



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/03/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OISEST/0.0/FIX/2.776	EUR	5 000 000	-11,30	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.778	EUR	5 000 000	-9,28	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.782	EUR	500 000	-30,22	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.797	EUR	8 000 000	2 818,84	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.848	EUR	4 000 000	-520,40	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.869	EUR	10 000 000	2 760,46	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.875	EUR	2 000 000	861,82	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.918	EUR	5 000 000	919,36	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.920	EUR	7 000 000	1 256,48	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.962	EUR	10 000 000	1 311,56	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.026	EUR	5 000 000	-471,08	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.055	EUR	10 000 000	-4 892,35	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.056	EUR	2 000 000	3 484,75	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.065	EUR	5 000 000	1 501,83	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.073	EUR	15 000 000	-1 200,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.112	EUR	5 000 000	626,42	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.116	EUR	10 000 000	-2 081,91	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.161	EUR	10 000 000	-7 990,25	-0,01
OISEST/0.0/FIX/3.175	EUR	10 000 000	4 325,78	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.186	EUR	5 000 000	2 473,71	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.204	EUR	10 000 000	-5 141,37	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.213	EUR	3 000 000	-1 578,79	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.223	EUR	20 000 000	-19 256,24	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.230	EUR	10 000 000	-10 697,30	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.309	EUR	5 000 000	-6 337,23	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.389	EUR	5 000 000	-10 702,28	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.434	EUR	20 000 000	-51 699,14	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.56	EUR	3 000 000	-10 120,94	0,00
TOTAL Swaps de taux			974 971,59	0,08
TOTAL Autres instruments financiers à terme			974 971,59	0,08
TOTAL Instrument financier à terme			974 971,59	0,08
Dettes			-1 515 950,01	-0,12
Comptes financiers			92 305 680,06	7,63
Actif net			1 209 460 556,22	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