



## NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

OPCVM de droit français

# OSTRUM ISR EONIA 6-12 MOIS

## RAPPORT SEMESTRIEL

au 31 mars 2021

**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	846 464 294,42
b) Avoirs bancaires	236 395 908,98
c) Autres actifs détenus par l'OPC	174 976 136,80
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	1 257 836 340,20
e) Passif	-13 511 962,37
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	1 244 324 377,83

\* 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 ISR EONIA 6-12 MOIS E en EUR	C	38 278 184,86	3 732,64518	10 254,97
OSTRUM ISR EONIA 6-12 MOIS I en EUR	C	1 206 046 192,97	116 099,46979	10 388,04



## ● 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.	60,26	59,61
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.	7,76	7,68
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	9,37	9,27

\* 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	833 035 537,21	66,95	66,23
Couronne Suédoise	SEK	13 428 757,21	1,08	1,07
TOTAL		846 464 294,42	68,03	67,30

\* 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	28,68	28,37
ETATS-UNIS	6,87	6,79
PAYS-BAS	6,74	6,67
ITALIE	6,36	6,29
ESPAGNE	5,41	5,35
ALLEMAGNE	4,12	4,08
ROYAUME-UNI	2,79	2,76
SUEDE	2,29	2,26
IRLANDE	1,61	1,59
BELGIQUE	1,21	1,20
LUXEMBOURG	1,05	1,04
JAPON	0,90	0,89
TOTAL	68,03	67,30

\* 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	9,37	9,27
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE		
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés		
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés		
Autres organismes non européens		
<b>Autres actifs</b>		
Autres		
<b>TOTAL</b>	<b>9,37</b>	<b>9,27</b>

\* 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**

Eléments 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.	1 964 585 379,24	1 867 995 348,40
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.	86 590 444,58	2 500 000,00
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	62 074 926,66	32 222 368,37

**• INFORMATIONS DIVERSES**

**Etablissement dépositaire :** CACEIS Bank - 1-3 place Valhubert - 75013 - Paris

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)**

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



## • PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Dépôts</b>				
DAT ECH.23042021	EUR	10 000 000	9 994 417,26	0,80
<b>TOTAL Dépôts</b>			<b>9 994 417,26</b>	<b>0,80</b>
<b>Obligations et valeurs assimilées</b>				
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
BERTELSMANN 2.625% 08/22	EUR	1 200 000	1 268 254,44	0,10
DAIGR 2 1/4 01/24/22	EUR	2 000 000	2 051 396,71	0,17
DAIMLER AG 2.375% 12/09/2022	EUR	5 000 000	5 257 895,55	0,42
VOLKSWAGEN BANK 0.625% 08-09-21	EUR	15 000 000	15 114 613,36	1,22
VOLKSWAGEN BANK E3R+0.42% 15-06-21	EUR	2 300 000	2 301 679,00	0,18
VOLKSWAGEN LEASING E3R+0.45% 02-08-21	EUR	700 000	700 752,50	0,06
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>26 694 591,56</b>	<b>2,15</b>
<b>ESPAGNE</b>				
BANCO NTANDER 1.375% 09-02-22	EUR	2 000 000	2 034 929,18	0,16
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>2 034 929,18</b>	<b>0,16</b>
<b>ETATS-UNIS</b>				
AMER HON 1.375% 10-11-22 EMTN	EUR	5 000 000	5 161 063,36	0,42
ATT 0.0% 01-04-22 EMTN	EUR	35 000 000	35 123 725,00	2,82
CITIGROUP GLOBAL MKTS E3R+0.75% 24-02-22	EUR	10 000 000	10 044 607,50	0,80
JPM 1 3/8 09/16/21	EUR	10 000 000	10 161 395,89	0,81
TOYO MOT 0.75% 21-07-22 EMTN	EUR	9 278 000	9 458 196,55	0,76
WELL FAR 1.5% 12-09-22 EMTN	EUR	15 000 000	15 509 336,30	1,25
<b>TOTAL ETATS-UNIS</b>			<b>85 458 324,60</b>	<b>6,86</b>
<b>FRANCE</b>				
BNP PARIBAS 2.875% 24/10/22	EUR	5 000 000	5 320 989,04	0,43
CA SA 0%12-090822	EUR	1 300 000	1 930 305,00	0,16
CREDIT AGRICOLE SA 3.15% 29/10/2022	EUR	1 700 000	1 801 256,25	0,15
CREDIT AGRICOLE SA 3.5% 02/10/2022	EUR	5 500 000	5 811 930,38	0,47
DANONE 2 1/4 11/15/21	EUR	2 000 000	2 036 816,85	0,16
ENGIE 0.5% 13-03-22 EMTN	EUR	1 200 000	1 207 696,52	0,09
ENGIE 3.5% 10-22	EUR	3 900 000	4 195 839,84	0,33
RENAULT CREDIT INTL BANQUE 0.625% 10-11-21	EUR	1 000 000	1 005 827,12	0,08
SG E3R+0.65% 06-09-21 EMTN	EUR	5 000 000	5 013 739,03	0,40
THALES 0.0% 31-05-22 EMTN	EUR	1 000 000	1 002 800,00	0,08
VEOLIA ENVIRONNEMENT 0.672% 30-03-22	EUR	900 000	906 825,49	0,08
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>30 234 025,52</b>	<b>2,43</b>
<b>ITALIE</b>				
UBI BANCA UNIONE DI BANCHE ITALIANE STEP E3R+0.49% 09-12-21	EUR	7 000 000	7 000 234,11	0,57
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>7 000 234,11</b>	<b>0,57</b>
<b>JAPON</b>				
TAKEDA PHARMACEUTICAL 1.125% 21-11-22	EUR	10 867 000	11 147 605,30	0,89
<b>TOTAL JAPON</b>			<b>11 147 605,30</b>	<b>0,89</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				

● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
HEIGR 3 1/4 10/21/21	EUR	3 000 000	3 095 447,50	0,25
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>3 095 447,50</b>	<b>0,25</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
BMW 2 3/8 01/24/23	EUR	8 000 000	8 419 879,45	0,68
DAIMLER INTL FINANCE BV 0.25% 09-08-21	EUR	9 100 000	9 135 160,90	0,73
DAIMLER INTL FINANCE BV 0.25% 11-05-22	EUR	2 688 000	2 710 136,42	0,22
DAIMLER INTL FINANCE BV 0.625% 27-02-23	EUR	7 000 000	7 112 109,80	0,57
ED 2.625% 18-01-22 EMTN	EUR	1 000 000	1 028 944,59	0,08
REPSM 3.625% 10/07/21	EUR	3 800 000	3 945 733,90	0,32
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0.8% 20-05-22	EUR	10 000 000	10 027 219,72	0,81
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>42 379 184,78</b>	<b>3,41</b>
<b>ROYAUME-UNI</b>				
CRED SUIS SA AG LONDON BRANCH E3R+0.95% 18-05-22	EUR	7 150 000	7 217 255,48	0,58
UBS 1 1/4 09/03/21	EUR	2 000 000	2 029 406,03	0,16
UBS BK OF SWITZERLAND LON 0.125% 05-11-21	EUR	15 400 000	15 457 758,44	1,24
<b>TOTAL ROYAUME-UNI</b>			<b>24 704 419,95</b>	<b>1,98</b>
<b>SUEDE</b>				
SCANIA CV AB 0.0% 23-11-22	EUR	5 000 000	5 006 700,00	0,41
<b>TOTAL SUEDE</b>			<b>5 006 700,00</b>	<b>0,41</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>237 755 462,50</b>	<b>19,11</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées</b>			<b>237 755 462,50</b>	<b>19,11</b>
<b>Titres de créances</b>				
<b>Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
VOLKSWAGEN AG 040222 FIX -0.31	EUR	24 545 455	24 615 476,25	1,97
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>24 615 476,25</b>	<b>1,97</b>
<b>BELGIQUE</b>				
BNP PARIBAS FORTIS SA 151121 FIX -0.47	EUR	15 000 000	15 048 224,54	1,21
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>15 048 224,54</b>	<b>1,21</b>
<b>ESPAGNE</b>				
SPAI LETR DEL TESO ZCP 04-03-22	EUR	55 000 000	55 265 918,11	4,44
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>55 265 918,11</b>	<b>4,44</b>
<b>FRANCE</b>				
ALTA COGEDIM FLR+0.2% 07-04-21	EUR	10 000 000	10 011 472,22	0,81
ATOS SE 060921 FIX -0.395	EUR	24 000 000	24 045 094,56	1,93
AXA SA 280621 FIX -0.225	EUR	15 000 000	15 020 184,01	1,21
BANQ P E3R+0.27% 19-11-21	EUR	15 000 000	15 005 866,44	1,21
BFCM (BANQUE FED 031221 FIX -0.49	EUR	20 000 000	20 074 087,10	1,61
BFCM (BANQUE FED 150921 FIX -0.44	EUR	5 000 000	5 013 100,24	0,40
CAIS F E3R+0.2% 12-06-21	EUR	5 000 000	4 999 297,22	0,40
CFCM M E3R+0.245% 15-11-21	EUR	15 000 000	15 062 026,03	1,21
COFACE 010721 FIX -0.2	EUR	9 000 000	9 008 062,18	0,72
CRED D E3R+0.28% 28-02-22	EUR	15 000 000	14 998 655,83	1,20
CREDIT INDUSTRIEL ET COMMERCIAL 031221 F	EUR	10 000 000	10 038 186,43	0,81



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CREDIT INDUSTRIEL ET COMMERCIAL 150921 F	EUR	10 000 000	10 026 932,67	0,81
CREDIT INDUSTRIEL ET COMMERCIAL 240621 F	EUR	7 000 000	7 009 679,43	0,56
CSSE F E3R+0.24% 25-11-21	EUR	10 000 000	9 990 023,29	0,81
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 040122 FIX -0.	EUR	20 000 000	20 076 113,06	1,62
ENGIE SA 210421 FIX -0.565	EUR	8 000 000	8 002 249,52	0,65
KLEPIERRE 070721 FIX -0.485	EUR	3 000 000	3 003 930,02	0,24
PSA BA E3R+0.4% 23-12-21	EUR	8 000 000	8 021 725,81	0,65
PSA BANQ FRAN 0.2% 18-06-21	EUR	6 000 000	6 028 750,00	0,48
PSA BANQUE FRANCE 160721 OIS 0.49	EUR	4 000 000	4 006 023,03	0,32
RENAULT CREDIT I 070921 FIX -0.31	EUR	10 000 000	10 017 429,12	0,80
SG ZCP 03-01-22	EUR	5 000 000	5 018 947,34	0,40
SOCIETE DES AUTOR 240621 FIX -0.035	EUR	8 000 000	8 006 972,66	0,64
STIF ZCP 150621 FIX -0.405	EUR	19 000 000	19 019 558,45	1,53
SYND TRAN IDF 15-06-21 FIX -0,41	EUR	16 000 000	16 016 470,27	1,28
THALES SA 011021 FIX -0.41	EUR	10 000 000	10 022 872,81	0,81
UNIBAIL RODAMCO SE 101121 FIX -0.405	EUR	10 000 000	10 030 486,74	0,81
VALEO SA 030521 FIX -0.235	EUR	3 000 000	3 001 077,02	0,24
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 070421 FIX -0.4	EUR	6 000 000	6 000 495,44	0,48
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 231121 FIX -0.39	EUR	20 000 000	20 064 627,42	1,61
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>326 640 396,36</b>	<b>26,25</b>
<b>ITALIE</b>				
ITAL BUON ORDI DEL ZCP 30-09-21	EUR	25 000 000	25 062 084,35	2,01
ITAL BUON ORDI DEL ZCP 31-08-21	EUR	37 000 000	37 079 845,27	2,99
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>62 141 929,62</b>	<b>5,00</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
ARCELORMITTAL 130421 FIX -0.115	EUR	10 000 000	10 001 449,24	0,81
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>10 001 449,24</b>	<b>0,81</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
AMERICA MOVIL SAB DE CV 100521 FIX -0.38	EUR	22 500 000	22 511 530,22	1,81
AMERICA MOVIL SAB DE CV 170621 FIX -0.46	EUR	9 000 000	9 008 955,28	0,72
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>31 520 485,50</b>	<b>2,53</b>
<b>ROYAUME-UNI</b>				
UNICREDIT SPA LONDON BRANCH STEP UP 23-04-21	EUR	10 000 000	10 002 066,67	0,80
<b>TOTAL ROYAUME-UNI</b>			<b>10 002 066,67</b>	<b>0,80</b>
<b>SUEDE</b>				
VATTENFALL AB 240521 FIX -0.34	EUR	10 000 000	10 006 460,07	0,81
VOLKSWAGEN FINANS SVERIGE AB 220621 FIX 0.25	SEK	37 500 000	3 662 424,97	0,29
<b>TOTAL SUEDE</b>			<b>13 668 885,04</b>	<b>1,10</b>
<b>TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>548 904 831,33</b>	<b>44,11</b>
<b>Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ESPAGNE</b>				
SANTANDER CONSUMER FINANCE S.A 110621 FI	EUR	10 000 000	10 010 982,86	0,81
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>10 010 982,86</b>	<b>0,81</b>
<b>IRLANDE</b>				



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
FCA BANK SPA IRIS ZCP 06-10-21	EUR	10 000 000	9 995 542,73	0,81
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 040621 FIX 0.34	EUR	10 000 000	10 009 620,51	0,80
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>20 005 163,24</b>	<b>1,61</b>
<b>ITALIE</b>				
SNAM ZCP 03-06-21	EUR	10 000 000	10 008 309,77	0,80
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>10 008 309,77</b>	<b>0,80</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
COCA COLA HBC FINA ZCP 08-07-21	EUR	10 000 000	10 013 212,48	0,80
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>10 013 212,48</b>	<b>0,80</b>
<b>SUEDE</b>				
VOLK FINA SVER AB ZCP 17-06-21	SEK	100 000 000	9 766 332,24	0,79
<b>TOTAL SUEDE</b>			<b>9 766 332,24</b>	<b>0,79</b>
<b>TOTAL Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>59 804 000,59</b>	<b>4,81</b>
<b>TOTAL Titres de créances</b>			<b>608 708 831,92</b>	<b>48,92</b>
<b>Organismes de placement collectif</b>				
<b>OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>				
<b>FRANCE</b>				
LBP ISR EONIA 3-6 MOIS I	EUR	5 587	56 881 247,00	4,57
OSTRUM ISR CASH EONIA M	EUR	6 054	59 723 436,48	4,80
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>116 604 683,48</b>	<b>9,37</b>
<b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>			<b>116 604 683,48</b>	<b>9,37</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>116 604 683,48</b>	<b>9,37</b>
<b>Titres reçus en pension</b>				
<b>ESPAGNE</b>				
SPAIN GOVERNMENT BOND 1.45% 30-04-29	EUR	30 954 000	34 699 434,01	2,79
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>34 699 434,01</b>	<b>2,79</b>
<b>TOTAL Titres reçus en pension</b>			<b>34 699 434,01</b>	<b>2,79</b>
<b>Indemnités sur titres reçus en pension</b>			<b>-674,71</b>	
<b>Instrument financier à terme</b>				
<b>Engagements à terme fermes</b>				
<b>Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé</b>				
I EURIBOR 3 1221	EUR	-400	-7 500,00	
<b>TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé</b>			<b>-7 500,00</b>	
<b>TOTAL Engagements à terme fermes</b>			<b>-7 500,00</b>	
<b>Autres instruments financiers à terme</b>				
<b>Swaps de taux</b>				
E3R/0.0/FIX/-0.534	EUR	3 500 000	-353,33	
E3R/0.0/FIX/-0.537	EUR	8 000 000	-807,11	
E3R/0.0/FIX/-0.537	EUR	3 500 000	-163,18	
E3R/0.0/FIX/-0.54	EUR	1 000 000	-45,31	
E3R/0.0/FIX/-0.542	EUR	2 900 000	-51,11	
E3R/0.0/FIX/-0.542	EUR	5 000 000	-40,00	
E3R/0.0/FIX/-0.542	EUR	5 000 000	5 136,06	

● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 31/03/2021 EN EUR (suite)

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
E3R/0.0/FIX/-0.543	EUR	1 200 000	-82,56	
E3R/0.0/FIX/-0.545	EUR	5 000 000	6 486,16	0,01
E3R/0.0/FIX/-0.547	EUR	5 600 000	302,45	
E3R/0.0/FIX/-0.549	EUR	5 000 000	4 308,26	
E3R/0.0/FIX/-0.549	EUR	15 000 000	22 805,00	
E3R/0.0/FIX/-0.55	EUR	8 000 000	1 750,38	
E3R/0.0/FIX/-0.551	EUR	2 867 000	2 263,50	
E3R/0.0/FIX/-0.553	EUR	1 300 000	2 564,57	
E3R/0.0/FIX/-0.553	EUR	1 700 000	2 384,68	
E3R/0.0/FIX/-0.555	EUR	5 500 000	6 908,88	
E3R/0.0/FIX/-0.557	EUR	2 688 000	2 551,74	
E3R/0.0/FIX/-0.557	EUR	2 000 000	2 364,68	
E3R/0.0/FIX/-0.558	EUR	3 678 000	2 632,15	
OIS/0.0/FIX/-0.343	EUR	900 000	-1 144,27	
OIS/0.0/FIX/-0.49	EUR	2 000 000	222,10	
OIS/0.0/FIX/-0.491	EUR	9 100 000	1 252,89	
OIS/0.0/FIX/-0.492	EUR	30 000 000	4 825,80	
OIS/0.0/FIX/-0.492	EUR	10 000 000	-60,31	
OIS/0.0/FIX/-0.498	EUR	15 400 000	2 324,32	
OIS/0.0/FIX/-0.507	EUR	15 000 000	4 217,62	
OIS/0.0/FIX/-0.529	EUR	1 000 000	675,56	
OIS/0.0/FIX/-0.53	EUR	1 200 000	898,07	-0,01
<b>TOTAL Swaps de taux</b>			<b>74 127,69</b>	
<b>TOTAL Autres instruments financiers à terme</b>			<b>74 127,69</b>	
<b>TOTAL Instrument financier à terme</b>			<b>66 627,69</b>	
<b>Appel de marge</b>				
APPEL MARGE CACEIS	EUR	7 500	7 500,00	
<b>TOTAL Appel de marge</b>			<b>7 500,00</b>	
<b>Créances</b>			<b>13 593 901,89</b>	<b>1,10</b>
<b>Dettes</b>			<b>-13 501 241,74</b>	<b>-1,09</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>236 395 435,53</b>	<b>19,00</b>
<b>Actif net</b>			<b>1 244 324 377,83</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