



## NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

OPCVM de droit français

**OSTRUM SRI CASH A1P1**

**RAPPORT SEMESTRIEL**

au 30 mars 2023

**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	2 225 652 152,88
b) Avoirs bancaires	62 240 436,61
c) Autres actifs détenus par l'OPC	153 747 748,76
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	2 441 640 338,25
e) Passif	-335 338,06
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	2 441 305 000,19

\* 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 CASH A1P1 IC en EUR	C	2 387 953 904,78	20 621,7420	115 797,8751
OSTRUM SRI CASH A1P1 ID en EUR	D	13 135 663,56	120,0212	109 444,5278
OSTRUM SRI CASH A1P1 SOPRANE en EUR	C	40 215 431,85	3 924,1250	10 248,25



## ● 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.	77,05	77,04
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.	14,12	14,12
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	2 225 652 152,88	91,17	91,15
TOTAL		2 225 652 152,88	91,17	91,15

\* 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	42,44	42,43
BELGIQUE	10,73	10,73
ROYAUME-UNI	8,97	8,97
PAYS-BAS	6,57	6,57
SUEDE	6,11	6,10
FINLANDE	4,27	4,27
AUTRICHE	3,27	3,27
ALLEMAGNE	2,85	2,85
ETATS-UNIS	2,69	2,69
CANADA	1,23	1,23
SUISSE	1,23	1,23
NORVEGE	0,82	0,82
TOTAL	91,17	91,15

\* 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.	15 354 523 929,41	15 025 233 937,27
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.	1 538 978 421,46	1 395 000 000,00
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	0,00	0,00

## ● DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt (1) EUR	Montant brut unitaire (2) EUR
<b>Dividendes versés</b>			
OSTRUM SRI CASH A1P1 ID			
<b>Dividendes à verser</b>			
OSTRUM SRI CASH A1P1 ID			

(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 FRANCE - 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	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	151 587 500,00	0,00
% de l'Actif Net	0,00	0,00	0,00	6,21%	0,00

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

DEXIA CREDIT LOCAL DE FRANCE GARANTI FRANCE	0,00			62 805 000,00	0,00
CADES CAISSE D AMORTISSEMENT ET DE LA DETTE SOCIALE FRANCE	0,00			56 537 000,00	0,00
EUROPEAN UNION BELGIQUE	0,00			29 645 500,00	0,00
EUROPEAN FINL STABILITY FACIL LUXEMBOURG	0,00			2 600 000,00	0,00

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

LA BANQUE POSTALE FRANCE	0,00	0,00	0,00	120 477 500,00	0,00
CREDIT AGRICOLE CIB FRANCE	0,00	0,00	0,00	31 110 000,00	0,00

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

<b>Type</b>					
- Actions	0,00			0,00	0,00
- Obligations	0,00			151 587 500,00	0,00
- OPC	0,00			0,00	0,00
- TCN	0,00			0,00	0,00
- Cash	0,00		0,00		0,00
<b>Rating</b>	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
<b>Monnaie de la garantie</b>					
Euro	0,00		0,00	151 587 500,00	0,00





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

**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			31 110 000,00	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			80 210 000,00	0,00
Ouvertes	0,00			40 267 500,00	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	151 587 500,00	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			151 587 500,00	0,00
Cash	0,00				0,00



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

**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**

Revenus					
- OPC	0,00	0,00	0,00	1 043 131,14	
- Gestionnaire	0,00	0,00	0,00	0,00	
- Tiers	0,00	0,00	0,00	0,00	
Coûts					
- OPC	0,00	0,00	0,00	5 061,59	
- 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 30/03/2023 EN EUR**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Titres de créances</b>				
<b>Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
ALLIANZ SE 290923 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 674 332,74	0,81
SAP SE 020623 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 895 988,25	0,81
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>39 570 320,99</b>	<b>1,62</b>
<b>AUTRICHE</b>				
OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 080523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 938 024,64	0,81
OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 150523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 926 104,04	0,82
OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 200423 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 967 686,74	0,82
OESTERREICHISCHE KONTROLLBANK AG 310323 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 000 000,00	0,82
<b>TOTAL AUTRICHE</b>			<b>79 831 815,42</b>	<b>3,27</b>
<b>BELGIQUE</b>				
FLEMISH COMMUNITY 190423 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 984 536,31	0,41
KBC BANK NV 310323 FIX 0.0	EUR	110 000 000	110 000 000,00	4,51
LA REGION DE BRUXELLES-CAPITALE 170723 FIX 0.0	EUR	13 000 000	12 881 653,67	0,52
LVMH FINANCE BELGIQUE 120723 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 912 124,66	0,41
LVMH FINANCE BELGIQUE SA 010623 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 897 617,14	0,81
LVMH FINANCE BELGIQUE SA 010823 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 893 196,59	0,41
LVMH FINANCE BELGIQUE SA 110923 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 707 501,27	0,81
LVMH FINANCE BELGIQUE SA 240723 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 900 781,38	0,41
SUMITOMO MITSU 030523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 945 424,33	0,82
SUMITOMO MITSU 080523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 936 656,81	0,81
SUMITOMO MITSU 220523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 911 416,32	0,82
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>261 970 908,48</b>	<b>10,74</b>
<b>CANADA</b>				
TORONTO DOMINION BANK, THE 080523 FIX 0.	EUR	10 000 000	9 970 601,85	0,41
TORONTO DOMINION BANK, THE 240423 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 963 165,30	0,82
<b>TOTAL CANADA</b>			<b>29 933 767,15</b>	<b>1,23</b>
<b>ETATS-UNIS</b>				
COLGATE PALMOLIVE CO 130423 FIX 0.0	EUR	12 000 000	11 987 457,72	0,49
HONEYWELL INTERNATIONAL INC 150623 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 934 074,72	0,41
HONEYWELL INTERNATIONAL INC 160523 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 961 161,32	0,41
HONEYWELL INTERNATIONAL INC 210623 FIX 0	EUR	10 000 000	9 928 404,13	0,40
<b>TOTAL ETATS-UNIS</b>			<b>41 811 097,89</b>	<b>1,71</b>
<b>FINLANDE</b>				
NORDEA BANK ABP. 150923 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 709 352,74	0,81
NORDEA BANK ABP. 170723 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 774 701,34	1,02
NORDEA BANK ABP. 240523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 911 866,10	0,81
OP CORPORATE BANK PLC 010623 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 899 925,49	0,82
OP CORPORATE BANK PLC 090623 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 886 132,01	0,81
<b>TOTAL FINLANDE</b>			<b>104 181 977,68</b>	<b>4,27</b>
<b>FRANCE</b>				
AGENCE CENTRAL 110423 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 974 177,75	1,23
AGENCE CENTRAL 200423 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 953 081,83	1,22
AGENCE CENTRAL 260523 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 866 143,93	1,22
AXA SA 090623 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 884 394,34	0,82



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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
AXA SA 150523 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 908 154,29	1,02
AXA SA 200623 FIX 0.0	EUR	19 000 000	18 872 922,01	0,78
BANQUE PALATINE 310323 OISEST 0.04	EUR	20 000 000	20 055 433,58	0,83
BFCM (BANQUE FEDER 110923 OISEST 0.18	EUR	20 000 000	20 056 938,20	0,83
BFCM (BANQUE FEDER 180923 OISEST 0.14	EUR	20 000 000	20 020 292,53	0,82
BFCM (BANQUE FEDER 230523 OISEST 0.21	EUR	10 000 000	10 082 503,64	0,41
BFCM (BANQUE FEDER 290523 OISEST 0.21	EUR	10 000 000	10 080 488,29	0,41
BFCM B OISEST+0.15% 11-04-23	EUR	20 000 000	20 184 765,96	0,83
BNP PA OISEST+0.1% 12-06-23	EUR	20 000 000	20 139 180,74	0,82
BNP PARIBAS 080823 OISEST 0.13	EUR	20 000 000	20 079 441,50	0,83
BNP PARIBAS 140823 OISEST 0.13	EUR	20 000 000	20 072 189,00	0,83
BNP PARIBAS 200923 OISEST 0.11	EUR	20 000 000	20 018 749,04	0,82
BPCE SA 040523 OISEST 0.04	EUR	30 000 000	30 025 051,90	1,23
BPCE SA 080523 OISEST 0.05	EUR	30 000 000	30 016 532,64	1,23
BPIFRANCE SA 120623 OISEST 0.05	EUR	20 000 000	20 134 592,97	0,83
BPIFRANCE SA 240523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 912 038,57	0,81
BPIFRANCE SA 300623 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 847 318,82	0,81
BPIFRANCE SA 310523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 900 098,91	0,82
CAISSE FEDERALE D 200423 OISEST 0.1	EUR	10 000 000	10 047 842,14	0,41
CDC HABITAT 020523 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 974 019,67	0,41
CDC HABITAT 050523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 942 789,40	0,81
CDC HABITAT 061123 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 577 490,56	0,80
CDC HABITAT 200623 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 929 095,83	0,41
CDC HABITAT 260723 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 789 519,66	0,81
CFCM MAINE ANJOU BASSE NORMANDIE 280423	EUR	20 000 000	20 084 905,67	0,82
CRCA A OISEST+0.1% 24-04-23	EUR	20 000 000	20 092 671,97	0,82
CRCAM ANJOU ET MAINE 210423 OISEST 0.11	EUR	20 000 000	20 103 990,39	0,82
CRCAM BRIE PICARDIE 100523 OISEST 0.1	EUR	20 000 000	20 072 083,57	0,82
CRCAM PARIS ILE DE FRANCE 290523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 901 316,89	0,81
CREDIT AGRICOLE SA 100723 OISEST 0.16	EUR	20 000 000	20 112 058,22	0,82
CREDIT AGRICOLE SA 110923 OISEST 0.16	EUR	20 000 000	20 035 485,44	0,82
CREDIT AGRICOLE SA 130623 OISEST 0.09	EUR	20 000 000	20 027 863,70	0,82
CREDIT AGRICOLE SA 170523 OISEST 0.07	EUR	20 000 000	20 022 288,09	0,82
KERING FINANCE (EX PPR FINANCE) 050623 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 882 137,03	0,81
KERING FINANCE (EX PPR FINANCE) 090623 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 937 344,49	0,40
KERING FINANCE (EX PPR FINANCE) 150523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 922 432,01	0,82
KERING FINANCE (EX PPR FINANCE) 230623 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 848 362,48	0,82
LA BANQUE POSTALE 310323 FIX 0.0	EUR	110 000 000	110 000 000,00	4,51
LA POSTE 190423 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 984 720,47	0,41
L OREAL S A 220623 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 861 202,58	0,81
STE ANONYME DE 270423 FIX 0.0	EUR	17 000 000	16 962 707,91	0,69
STE ANONYME DE 270423 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 956 126,95	0,82
STE ANONYME DE 270423 FIX 0.0	EUR	16 000 000	15 964 901,56	0,65
SYNDICAT TRANS 270423 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 978 148,60	0,41
UNION NAT. INT 250423 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 959 390,96	0,82
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>1 036 055 386,68</b>	<b>42,44</b>



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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>NORVEGE</b>				
DNB BANK ASA 020623 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 902 678,89	0,81
<b>TOTAL NORVEGE</b>			<b>19 902 678,89</b>	<b>0,81</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
BNG BANK N.V. 040423 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 990 677,56	1,23
BNG BANK N.V. 050423 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 988 354,94	1,23
BNG BANK N.V. 060423 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 986 035,50	1,22
COOPERATIEVE RABOBANK UA 060923 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 704 392,89	0,81
ING BANK N.V. 180523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 921 496,02	0,82
KINGDOM OF THE NETHERLANDS 060423 FIX 0.	EUR	11 000 000	10 994 946,36	0,45
LINDE FINANCE BV 190523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 920 331,57	0,81
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>160 506 234,84</b>	<b>6,57</b>
<b>ROYAUME-UNI</b>				
MIZUHO BANK LTD (GB) 100523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 933 071,39	0,82
MIZUHO BANK LTD (GB) 170423 FIX 0.0	EUR	40 000 000	39 944 460,78	1,64
MUFG BANK LTD 080523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 936 984,07	0,81
MUFG BANK LTD 150523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 924 823,64	0,81
MUFG BANK LTD 170423 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 972 089,12	0,81
ROYA BANK OF CANA ZCP 15-05-23	EUR	10 000 000	9 962 574,34	0,41
ROYAL BANK OF CANADA 260423 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 955 930,54	0,82
TORONTO DOMINION BANK, THE 210923 FIX 0.	EUR	20 000 000	19 686 195,48	0,81
UBS AG LONDON 240423 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 960 572,55	0,82
<b>TOTAL ROYAUME-UNI</b>			<b>189 276 701,91</b>	<b>7,75</b>
<b>SUEDE</b>				
SEB HYPOTHEKENBANK AG 220623 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 862 962,55	0,81
SEB HYPOTHEKENBANK AG 250923 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 510 993,49	1,21
SKANDINAVISKA ENSKI 280423 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 978 308,27	0,41
SKANDINAVISKA ENSKIL 250423 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 961 258,52	0,82
SVENSKA HANDELSBANKEN AB 130423 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 979 829,20	0,82
SVENSKA HANDELSBANKEN AB 150623 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 876 044,37	0,81
SVENSKA HANDELSBANKEN AB 170423 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 973 629,09	0,82
<b>TOTAL SUEDE</b>			<b>139 143 025,49</b>	<b>5,70</b>
<b>SUISSE</b>				
EUROFIMA EUROP 240423 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 944 632,37	1,23
<b>TOTAL SUISSE</b>			<b>29 944 632,37</b>	<b>1,23</b>
<b>TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>2 132 128 547,79</b>	<b>87,34</b>
<b>Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
SAP SE 100523 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 935 051,60	0,82
SAP SE 280423 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 977 469,65	0,40
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>29 912 521,25</b>	<b>1,22</b>
<b>ETATS-UNIS</b>				
COLGATE PALMOLIVE CO 110423 FIX 0.0	EUR	24 000 000	23 978 769,73	0,98
<b>TOTAL ETATS-UNIS</b>			<b>23 978 769,73</b>	<b>0,98</b>
<b>ROYAUME-UNI</b>				
UBS AG LONDON 140823 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 756 508,50	0,81
UBS AG LONDON ZCP 10-05-23	EUR	10 000 000	9 966 617,37	0,41



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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>ROYAUME-UNI</b>				
UBS AG LONDON 140823 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 756 508,50	0,81
UBS AG LONDON ZCP 10-05-23	EUR	10 000 000	9 966 617,37	0,41
<b>TOTAL ROYAUME-UNI</b>			<b>29 723 125,87</b>	<b>1,22</b>
<b>SUEDE</b>				
SVENSKA HANDELSBANKEN AB 170723 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 909 188,24	0,41
<b>TOTAL SUEDE</b>			<b>9 909 188,24</b>	<b>0,41</b>
<b>TOTAL Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>93 523 605,09</b>	<b>3,83</b>
<b>TOTAL Titres de créances</b>			<b>2 225 652 152,88</b>	<b>91,17</b>
<b>Titres reçus en pension</b>				
<b>BELGIQUE</b>				
EUROPEAN UNION 0.1% 04-10-40	EUR	9 000 000	5 085 000,00	0,21
EUROPEAN UNION 0.75% 04-01-47	EUR	10 000 000	5 800 000,00	0,23
EUROPEAN UNION 2.75% 04-02-33	EUR	8 800 000	8 712 000,00	0,36
EUROPEAN UNION 3.25% 04-07-34	EUR	9 900 000	10 048 500,00	0,41
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>29 645 500,00</b>	<b>1,21</b>
<b>FRANCE</b>				
CADES 0.0% 25-02-28	EUR	2 300 000	1 955 000,00	0,08
CADES 0.125% 15-09-31	EUR	10 500 000	8 022 000,00	0,33
CADES 4.125% 11-23	EUR	30 000 000	31 110 000,00	1,27
CADES 4% 15/12/25	EUR	15 000 000	15 450 000,00	0,64
DEXGRP 0 1/2 01/17/25	EUR	25 900 000	24 605 000,00	1,00
DEXIA 0.0% 21-01-28 EMTN	EUR	28 000 000	23 800 000,00	0,98
DEXIA 0.0% 29-05-24 EMTN	EUR	15 000 000	14 400 000,00	0,59
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>119 342 000,00</b>	<b>4,89</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
EFSF 0.7 01/20/50	EUR	5 000 000	2 600 000,00	0,11
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>2 600 000,00</b>	<b>0,11</b>
<b>TOTAL Titres reçus en pension</b>			<b>151 587 500,00</b>	<b>6,21</b>
<b>Indemnités sur titres reçus en pension</b>			<b>230 843,00</b>	<b>0,01</b>
<b>Instrument financier à terme</b>				
<b>Autres instruments financiers à terme</b>				
<b>Swaps de taux</b>				
OISEST/0.0/FIX/1.876	EUR	20 000 000	226,28	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.902	EUR	20 000 000	2 625,83	0,00
OISEST/0.0/FIX/1.984	EUR	10 000 000	3 713,66	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.008	EUR	10 000 000	2 746,99	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.012	EUR	20 000 000	2 655,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.033	EUR	20 000 000	-2 011,15	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.04	EUR	20 000 000	-2 705,60	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.058	EUR	20 000 000	-3 310,79	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.147	EUR	10 000 000	1 199,79	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.196	EUR	10 000 000	-390,37	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.197	EUR	20 000 000	6 248,89	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.23	EUR	10 000 000	-95,70	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.296	EUR	20 000 000	8 872,66	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.315	EUR	20 000 000	7 888,69	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.326	EUR	20 000 000	13 444,89	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/2.4	EUR	20 000 000	11 702,09	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.409	EUR	20 000 000	2 737,47	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.425	EUR	10 000 000	702,41	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.426	EUR	10 000 000	668,74	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.579	EUR	10 000 000	345,80	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.631	EUR	20 000 000	1 144,14	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.632	EUR	20 000 000	105,09	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.645	EUR	20 000 000	94,25	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.650	EUR	20 000 000	136,70	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.652	EUR	10 000 000	1 887,13	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.656	EUR	20 000 000	679,17	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.676	EUR	20 000 000	329,24	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.689	EUR	30 000 000	204,60	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.702	EUR	20 000 000	146,83	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.721	EUR	10 000 000	2 342,09	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.724	EUR	20 000 000	-399,69	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.724	EUR	25 000 000	-499,61	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.726	EUR	10 000 000	47,59	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.727	EUR	25 000 000	5 255,88	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.735	EUR	20 000 000	1 035,29	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.736	EUR	20 000 000	218,31	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.748	EUR	13 000 000	757,24	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.782	EUR	20 000 000	134,45	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.788	EUR	20 000 000	238,66	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.797	EUR	20 000 000	3 499,76	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.801	EUR	10 000 000	3 436,53	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.809	EUR	20 000 000	-159,95	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.835	EUR	20 000 000	-940,89	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.845	EUR	20 000 000	-945,78	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.852	EUR	19 000 000	5 931,47	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.853	EUR	20 000 000	-2 256,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.863	EUR	20 000 000	-2 209,29	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.866	EUR	20 000 000	-958,30	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.871	EUR	10 000 000	3 933,20	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.888	EUR	20 000 000	-2 715,19	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.889	EUR	20 000 000	-2 891,30	-0,01
OISEST/0.0/FIX/2.896	EUR	20 000 000	414,76	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.916	EUR	20 000 000	-3 569,47	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.918	EUR	20 000 000	3 616,35	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.919	EUR	20 000 000	3 671,35	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.944	EUR	30 000 000	-464,50	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.946	EUR	20 000 000	-550,12	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.949	EUR	20 000 000	-683,74	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.969	EUR	10 000 000	-3 114,29	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.974	EUR	20 000 000	-4 427,55	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.976	EUR	10 000 000	-2 266,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.997	EUR	10 000 000	-95,81	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.020	EUR	20 000 000	1 282,55	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/3.025	EUR	20 000 000	-7 603,89	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.031	EUR	20 000 000	-1 016,50	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.041	EUR	10 000 000	-4 574,71	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.047	EUR	20 000 000	5 206,40	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.105	EUR	20 000 000	1 877,54	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.105	EUR	10 000 000	-5 570,75	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.155	EUR	20 000 000	-710,09	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.208	EUR	30 000 000	-10 756,44	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.289	EUR	20 000 000	-23 749,02	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.402	EUR	20 000 000	-33 258,28	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.447	EUR	20 000 000	-42 103,47	0,00
<b>TOTAL Swaps de taux</b>			<b>-53 598,48</b>	<b>-0,01</b>
<b>TOTAL Autres instruments financiers à terme</b>			<b>-53 598,48</b>	<b>-0,01</b>
<b>TOTAL Instrument financier à terme</b>			<b>-53 598,48</b>	<b>-0,01</b>
<b>Créances</b>			<b>1 816 000,00</b>	<b>0,08</b>
<b>Dettes</b>			<b>-168 333,82</b>	<b>-0,01</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>62 240 436,61</b>	<b>2,55</b>
<b>Actif net</b>			<b>2 441 305 000,19</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