



## NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

OPCVM de droit français

# OSTRUM ISR OBLI CROSSOVER

## RAPPORT SEMESTRIEL

au 30 juin 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	261 195 040,70
b) Avoirs bancaires	794 292,94
c) Autres actifs détenus par l'OPC	71 464 023,15
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	333 453 356,79
e) Passif	-35 991 595,33
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	297 461 761,46

\* 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 OBLI CROSSOVER GP en EUR	C/D/R	6 832 885,01	64 384,19662	106,12
Ostrum ISR OBLI CROSSOVER I en EUR	C/D/R	120 068 206,31	9 680,52018	12 403,07
Ostrum ISR OBLI CROSSOVER L en EUR	C/D/R	170 560 670,14	139 913,31924	1 219,04



## ● 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.	76,50	68,24
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.	11,31	10,09
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.	5,05	4,51

\* 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	247 903 033,66	83,34	74,34
Dollar Us	USD	9 952 825,00	3,35	2,98
Livre Sterling	GBP	3 339 182,04	1,12	1,00
TOTAL		261 195 040,70	87,81	78,33

\* 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	22,72	20,26
PAYS-BAS	15,17	13,53
ITALIE	10,41	9,28
LUXEMBOURG	7,33	6,53
ALLEMAGNE	7,07	6,31
ESPAGNE	6,96	6,21
ETATS-UNIS	6,06	5,41
ROYAUME-UNI	3,80	3,39
SUEDE	3,19	2,84
PORTUGAL	1,39	1,24
JAPON	1,03	0,91
AUTRICHE	0,49	0,44
BELGIQUE	0,48	0,43
FINLANDE	0,48	0,42
DANEMARK	0,43	0,38
SUISSE	0,42	0,38
IRLANDE	0,40	0,36
TOTAL	87,81	78,33

\* 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	5,05	4,51
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>5,05</b>	<b>4,51</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

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.	241 215 639,21	225 225 422,53
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.	58 732 503,33	39 270 073,21
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.	85 093 185,79	97 701 529,94

## ● 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 ISR OBLI CROSSOVER GP			
Ostrum ISR OBLI CROSSOVER I			
Ostrum ISR OBLI CROSSOVER L			
<b>Dividendes à verser</b>			
Ostrum ISR OBLI CROSSOVER GP			
Ostrum ISR OBLI CROSSOVER I			
Ostrum ISR OBLI CROSSOVER L			

(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 - 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)**

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

**a) Titres et matières premières prêtés**

Montant					
% de l'Actif Net*					

\*% 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			19 650 983,07		
% de l'Actif Net			6,61%		

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

--	--	--	--	--	--

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

NATIXIS ASSET MANAGEMENT FINANCE FRANCE			16 553 831,78		
CACEIS FUND ADMINISTRATION FRANCE			1 255 427,67		
CACEIS BANK (FRANCE) FRANCE			1 026 691,51		
CEDEL LUXEMBOURG LUXEMBOURG			815 032,11		

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

Type					
- Actions					
- Obligations					
- OPC					
- TCN					
- Cash			20 362 967,55		
<b>Rating</b>					

Monnaie de la garantie					
Euro			20 362 967,55		





	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					
1 jour à 1 semaine					
1 semaine à 1 mois					
1 à 3 mois					
3 mois à 1 an					
Plus d'1 an					
Ouvertes					

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

Moins d'1 jour					
1 jour à 1 semaine					
1 semaine à 1 mois					
1 à 3 mois					
3 mois à 1 an					
Plus d'1 an					
Ouvertes			19 650 983,07		

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

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

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

CACEIS Bank					
Titres					
Cash					



	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					
Cash					

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

Revenus					
- OPC			11 193,93		
- Gestionnaire					
- Tiers					
Coûts					
- OPC			94,27		
- Gestionnaire					
- Tiers					

**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 NAM Finance, 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 Asset Management Finance 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 Asset Management Finance 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 30/06/2021 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Dépôts</b>				
Collat. espèces p/e	EUR	19 829 646,07	19 829 646,07	6,67
<b>TOTAL Dépôts</b>			<b>19 829 646,07</b>	<b>6,67</b>
<b>Obligations et valeurs assimilées</b>				
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
CMZB FRANCFORT 0.75% 24-03-26	EUR	1 300 000	1 327 293,23	0,45
DEUTSCHE BK 0.75% 17-02-27	EUR	1 300 000	1 312 420,16	0,44
DEUTSCHE BK 1.0% 19-11-25 EMTN	EUR	1 400 000	1 438 464,14	0,49
DEUTSCHE PFANDBRIEFBANK AG 2.875% 28-06-27	EUR	1 400 000	1 429 883,10	0,48
FRESENIUS SE 0.375% 28-09-26	EUR	2 500 000	2 537 389,73	0,85
IKB DEUTSCHE INDUSTRIEBANK AG 4.5% 23-07-22	EUR	2 200 000	2 382 787,00	0,80
MAHLESTIFTUNG 2.375% 14-05-28	EUR	3 200 000	3 202 362,74	1,08
MERCK KGAA 1.625% 09-09-80	EUR	1 400 000	1 462 955,32	0,49
SCHAEFFLER AG 2.75% 12-10-25	EUR	1 300 000	1 416 265,59	0,48
THYSSENKRUPP AG 1.875% 06-03-23	EUR	2 600 000	2 625 900,27	0,88
VOLKSWAGEN LEASING 0.25% 12-01-26	EUR	1 900 000	1 909 236,34	0,64
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>21 044 957,62</b>	<b>7,08</b>
<b>AUTRICHE</b>				
ERST GROU BA 8.875% PERP EMTN	EUR	1 400 000	1 461 213,51	0,49
<b>TOTAL AUTRICHE</b>			<b>1 461 213,51</b>	<b>0,49</b>
<b>BELGIQUE</b>				
SOLVAY 4.25% PERP	EUR	1 300 000	1 418 693,38	0,48
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>1 418 693,38</b>	<b>0,48</b>
<b>DANEMARK</b>				
CARLB 0 3/8 06/30/27	EUR	1 250 000	1 265 175,68	0,42
<b>TOTAL DANEMARK</b>			<b>1 265 175,68</b>	<b>0,42</b>
<b>ESPAGNE</b>				
ABANCA CORPORACION BANCARIA 6.125% 18-01-29	EUR	1 300 000	1 463 290,86	0,49
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 5.875% PERP	EUR	2 000 000	2 097 292,45	0,71
BANCO SANTANDER SA EUAR10+0.05% PERP	EUR	900 000	869 092,40	0,29
BANKIA SA 6.0% PERP	EUR	2 000 000	2 114 785,27	0,71
BBVA 2.575% 22-02-29 EMTN	EUR	1 600 000	1 702 081,97	0,57
BCO SANTANDER CENTRAL HISPANO 6.25% PERP	EUR	2 800 000	2 840 420,49	0,96
CAIXABANK 1.375% 19-06-26 EMTN	EUR	100 000	104 618,97	0,03
CELLNEX FINANCE 0.75% 15-11-26	EUR	1 400 000	1 394 407,10	0,47
EL CORTE INGLES 3.625% 15-03-24	EUR	2 900 000	3 038 200,69	1,02
GRUPO ANTOLIN IRAU 3.5% 30-04-28	EUR	1 700 000	1 699 210,05	0,57
HIPERCOR SA 3.875% 19-01-22	EUR	2 100 000	2 180 411,01	0,74
UNIO FENO E3R+0.65% PERP	EUR	1 600 000	1 190 778,40	0,40
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>20 694 589,66</b>	<b>6,96</b>
<b>ETATS-UNIS</b>				
BELDEN CDT 3.375% 15-07-27	EUR	1 350 000	1 411 554,94	0,48
COTY 3.875% 15-04-26	EUR	2 000 000	2 015 564,44	0,68
DEUT POST CMS10R+0.125% PERP	EUR	500 000	488 611,11	0,16



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2021 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
FORD MOTOR CREDIT 1.514% 17-02-23	EUR	2 000 000	2 043 879,45	0,70
FORD MOTOR CREDIT 1.744% 19-07-24	EUR	2 150 000	2 221 740,61	0,75
FORD MOTOR CREDIT E3R+0.37% 01-12-21	EUR	2 000 000	1 998 940,00	0,67
GOLD SACH GR E6R+0.0% 06-07-25	EUR	2 000 000	1 973 640,10	0,66
IQVIA 1.75% 15-03-26	EUR	1 350 000	1 373 253,38	0,46
IQVIA 2.875% 15-09-25	EUR	1 200 000	1 226 982,17	0,41
NETFLIX 3.0% 15-06-25	EUR	3 000 000	3 276 260,00	1,10
<b>TOTAL ETATS-UNIS</b>			<b>18 030 426,20</b>	<b>6,07</b>
<b>FINLANDE</b>				
NORDEA BANK AB PUBL 1.0% 07-09-26	EUR	1 400 000	1 414 314,14	0,47
<b>TOTAL FINLANDE</b>			<b>1 414 314,14</b>	<b>0,47</b>
<b>FRANCE</b>				
ALD 0.0000010% 23-02-24 EMTN	EUR	1 200 000	1 200 480,00	0,40
ALTAREA 2.25% 05-07-24	EUR	1 300 000	1 404 955,59	0,47
AUCHAN 2.875% 29-01-26 EMTN	EUR	1 000 000	1 126 540,14	0,38
AXA 4.5% PERP EMTN	USD	2 300 000	2 007 404,08	0,68
AXA SA EUAR10+0.2% PERP EMTN	EUR	1 200 000	1 062 568,00	0,35
AXA TV PERP	EUR	700 000	631 699,25	0,21
BFCM BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL EIS10R+0.1% PERP	EUR	1 250 000	1 195 215,31	0,40
BNP PARIBAS FIX PERP	EUR	2 800 000	2 953 832,69	0,99
BNP PARI L6RUSD+0.075% PERP	USD	2 400 000	1 912 689,82	0,64
CA 2.8% 21-07-26 EMTN	EUR	1 800 000	1 993 497,23	0,67
CAPGEMINI SE 0.625% 23-06-25	EUR	100 000	102 530,41	0,04
CREDIT AGRICOLE SA EUS10R+0.025% PERP	EUR	1 300 000	1 260 064,00	0,43
DANONE 0.0% 01-12-25 EMTN	EUR	1 700 000	1 708 109,00	0,58
DERICHEBOURG 2.25% 15-07-28	EUR	3 000 000	3 051 111,71	1,03
EDF 4.0% PERP	EUR	2 300 000	2 534 435,85	0,85
ELIS EX HOLDELIS 1.0% 03-04-25	EUR	2 000 000	1 998 391,51	0,67
FED.CR.MUT NORD EURO 04-PERP	EUR	1 800 000	1 722 873,80	0,57
FIN.CREDIT MUTUEL TV 04-PERP.	EUR	600 000	573 078,00	0,20
FNAC DARTY 2.625% 30-05-26	EUR	1 500 000	1 548 860,00	0,52
FRAN 0.125% 16-03-26	EUR	1 100 000	1 102 870,85	0,37
GROUPE DANONE 1.75% PERP EMTN	EUR	800 000	821 353,21	0,28
ILIAD 0.75% 11-02-24	EUR	2 400 000	2 405 825,42	0,80
IMERYYS 1.5% 15-01-27 EMTN	EUR	1 200 000	1 278 388,93	0,43
INDIGO GROUP SAS 1.625% 19-04-28	EUR	1 200 000	1 258 097,42	0,42
LOXAM SAS 3.25% 14-01-25	EUR	1 600 000	1 632 143,56	0,55
LOXAM SAS 5.75% 15-07-27	EUR	1 000 000	1 046 655,28	0,35
MOBILUX FINANCE SAS 4.25% 15-07-28	EUR	1 100 000	1 102 521,43	0,37
MUTUELLE ASSUR DES COMMERC ET IND FR 0.625% 21-06-27	EUR	3 000 000	2 985 295,07	1,01
MUTUELLE ASSUR DES COMMERC ET IND FR 3.5% PERP	EUR	1 500 000	1 512 977,87	0,51
ORPEA 2.0% 01-04-28	EUR	1 700 000	1 731 842,86	0,58
PERNOD RICARD 1.125% 07-04-25	EUR	2 400 000	2 512 825,64	0,84
PICARD GROUPE E3R+3.0% 30-11-23	EUR	2 300 000	2 300 835,67	0,78
PSA BANQUE FRANCE 0.75% 19-04-23	EUR	900 000	915 237,49	0,31
QUATRIM SASU 5.875% 15-01-24	EUR	2 100 000	2 202 816,29	0,74



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2021 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SFR GROUP 5.875% 01-02-27	EUR	2 000 000	2 171 924,72	0,73
SOCGEN 4 06/07/23	EUR	1 000 000	1 078 999,73	0,36
SOCI GENE 2.5% 16-09-26	EUR	1 000 000	1 025 244,52	0,35
TELEPERFORMANCE	EUR	1 200 000	1 187 031,78	0,40
TOTALENERGIES SE 1.625% PERP	EUR	500 000	504 517,12	0,17
UNIBAIL RODAMCO SE 2.125% PERP	EUR	300 000	302 221,44	0,10
VERALLIA SASU 1.625% 14-05-28	EUR	1 800 000	1 825 976,71	0,61
WORLDLINE 0.5% 30-06-23 EMTN	EUR	1 600 000	1 620 843,84	0,54
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>64 514 783,24</b>	<b>21,68</b>
<b>IRLANDE</b>				
BK IRELAND GROUP 0.375% 10-05-27	EUR	1 200 000	1 194 797,42	0,40
SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS 2.875% 15-01-26	EUR	1 000	1 120,69	
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>1 195 918,11</b>	<b>0,40</b>
<b>ITALIE</b>				
ACEA 0.0000010% 28-09-25 EMTN	EUR	1 200 000	1 200 336,00	0,40
ASSICURAZIONI GENERALI 4.125% 04/05/2026	EUR	300 000	354 101,34	0,12
AUTOSTRAD PER L ITALILIA SPA 6.25% 09-06-22	GBP	2 726 000	3 339 182,04	1,13
IGIM 0 1/4 06/24/25	EUR	1 900 000	1 912 207,11	0,64
INTE 0.625% 24-02-26 EMTN	EUR	2 400 000	2 403 868,27	0,80
INTESA SANPAOLO SPA 6.625% 13/09/2023	EUR	2 400 000	2 846 136,00	0,96
NEXI 1.625% 30-04-26	EUR	3 300 000	3 296 811,38	1,11
POSTE ITALIANE 0.0% 10-12-24	EUR	2 750 000	2 748 432,50	0,92
SNAM 0.0% 15-08-25 EMTN	EUR	1 550 000	1 549 147,50	0,52
TELECOM ITALIA SPA EX OLIVETTI 4.0% 11-04-24	EUR	2 450 000	2 669 437,44	0,89
TRASMISSIONE ELETTRICITA RETE NAZIONALE 0.125% 25-07-25	EUR	1 400 000	1 410 529,73	0,48
UNICREDI 4.375% 03-01-27 EMTN	EUR	2 400 000	2 504 916,82	0,84
UNICREDIT 0.325% 19-01-26 EMTN	EUR	1 200 000	1 200 348,33	0,41
UNICREDIT SPA 6.95% 31/10/2022	EUR	3 100 000	3 524 576,85	1,18
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>30 960 031,31</b>	<b>10,40</b>
<b>JAPON</b>				
NISSAN MOTOR 2.652% 17-03-26	EUR	98 000	107 656,37	0,04
SOFTBANK GROUP 4.0% 20-04-23	EUR	2 800 000	2 942 576,00	0,99
<b>TOTAL JAPON</b>			<b>3 050 232,37</b>	<b>1,03</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
ACEF HOLDING SCA 0.75% 14-06-28	EUR	3 000 000	2 996 219,59	1,01
BANQUE INTLE A LUXEMBOURG 1.75% 18-08-31	EUR	3 000 000	2 995 342,60	1,01
BLACKSTONE PROPERTY PARTNERS 1.0% 04-05-28	EUR	3 100 000	3 091 835,96	1,04
CNH INDU 2.875% 17-05-23 EMTN	EUR	1 500 000	1 588 969,93	0,53
DANFOSS FINANCE I BV 0.125% 28-04-26	EUR	1 600 000	1 598 884,16	0,54
INPOST 2.25% 15-07-27	EUR	1 900 000	1 915 575,25	0,64
LINCOLN FINANCING SARL E3R+3.875% 01-04-24	EUR	1 400 000	1 403 802,63	0,47
SIG COMBIBLOC PURCHASER 2.125% 18-06-25	EUR	2 150 000	2 275 899,82	0,76
SOCIETE EUROPEENNE DES SATELLITES SA 5.625% PERP	EUR	1 350 000	1 508 034,88	0,51
TRATON FINANCE LUXEMBOURG 0.125% 24-03-25	EUR	1 300 000	1 303 955,21	0,44
ZF FINANCE 2.0% 06-05-27 EMTN	EUR	1 100 000	1 110 992,62	0,38
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>21 789 512,65</b>	<b>7,33</b>



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2021 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>PAYS-BAS</b>				
ACHMEA BV TF/TV 04/04/2043	EUR	2 700 000	3 017 223,37	1,01
AEGON 0 07/29/49	USD	1 288 200	1 008 470,17	0,34
AEGON NV NLD10A PERP SUB *EUR	EUR	1 400 000	1 216 642,00	0,41
ATHORA NETHERLANDS NV 2.25% 15-07-31	EUR	850 000	867 363,99	0,29
CONTI GUMMI FINANCE BV 1.125% 25-09-24	EUR	1 100 000	1 146 651,15	0,38
CTP NV 0.5% 21-06-25 EMTN	EUR	1 900 000	1 893 598,30	0,64
IBERDROLA INTL BV 1.874% PERP	EUR	1 400 000	1 450 200,16	0,48
ING GROEP NV 0.875% 09-06-32	EUR	800 000	801 097,10	0,27
ING GROEP NV 1.0% 13-11-30	EUR	1 400 000	1 428 600,27	0,48
ING GROEP NV GNT10R+0.1% PERP	EUR	1 550 000	1 516 044,60	0,51
LEASEPLAN CORPORATION NV 0.25% 23-02-26	EUR	2 200 000	2 196 289,84	0,74
NIBC BANK NV 1.125% 19-04-23	EUR	1 700 000	1 743 249,40	0,59
NIBC BANK NV USI10R+0.1% PERP	USD	1 962 000	1 582 984,32	0,53
NOBEL BIDCO BV 3.125% 15-06-28	EUR	800 000	801 814,14	0,27
PPF ARENA 2.125% 31-01-25 EMTN	EUR	3 000 000	3 113 547,95	1,05
QPARK HOLDING I BV 1.5% 01-03-25	EUR	1 700 000	1 653 133,83	0,56
REPSOL INTL FINANCE BV 0.125% 05-10-24	EUR	1 700 000	1 713 284,92	0,58
REPSOL INTL FINANCE BV 3.75% PERP	EUR	1 600 000	1 718 540,05	0,58
STELLANTIS NV 0.625% 30-03-27	EUR	1 300 000	1 308 865,47	0,44
STELLANTIS NV 0.75% 18-01-29	EUR	1 800 000	1 795 027,81	0,60
STELLANTIS NV 3.375% 07-07-23	EUR	4 000 000	4 378 990,68	1,47
TELEFONICA EUROPE BV 3.0% PERP	EUR	2 700 000	2 841 291,74	0,95
TENNET HOLDING BV 2.995% PERP	EUR	1 900 000	2 002 968,03	0,68
VONO FINA BV 4.0% PERP	EUR	1 300 000	1 351 348,75	0,45
ZF EUROPE FINANCE BV 1.25% 23-10-23	EUR	2 500 000	2 563 050,34	0,86
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>45 110 278,38</b>	<b>15,16</b>
<b>PORTUGAL</b>				
BCP 1.125% 12-02-27 EMTN	EUR	3 000 000	2 961 435,21	1,00
CAIXA GERAL DE DEPOSITOS 10.75% PERP	EUR	1 000 000	1 072 137,22	0,36
NOS SGPS 1.125% 02-05-23	EUR	100 000	101 879,01	0,03
<b>TOTAL PORTUGAL</b>			<b>4 135 451,44</b>	<b>1,39</b>
<b>ROYAUME-UNI</b>				
BARCLAYS E3R+1.0% 12-05-26	EUR	1 500 000	1 529 717,38	0,52
BARCLAYS PLC 2.0% 07-02-28	EUR	2 600 000	2 687 243,53	0,90
DRES DR FIN 8.151% 30/06/31*USD	USD	1 800 000	2 178 491,53	0,73
FCE BANK 0.869% 13-09-21 EMTN	EUR	1 800 000	1 815 357,60	0,61
NOMAD FOODS BOND 2.5% 24-06-28	EUR	1 500 000	1 517 618,33	0,51
OTE 2.375% 18-07-22 EMTN	EUR	1 500 000	1 573 003,36	0,53
VODAFONE GROUP 3.1% 03-01-79	EUR	1 000	1 058,69	
<b>TOTAL ROYAUME-UNI</b>			<b>11 302 490,42</b>	<b>3,80</b>
<b>SUEDE</b>				
AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY AB 3.875% 05-10-78	EUR	1 400 000	1 524 480,14	0,51
INTRUM AB 4.875% 15-08-25	EUR	2 800 000	2 966 164,83	1,00
SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB 2.625% PERP	EUR	1 500 000	1 517 146,44	0,51
SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB 2.875% PERP	EUR	3 500 000	3 478 151,37	1,17



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2021 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>TOTAL SUEDE</b>			<b>9 485 942,78</b>	<b>3,19</b>
<b>SUISSE</b>				
UBS GROUP AG 7.125% PERP	USD	1 400 000	1 262 785,08	0,43
<b>TOTAL SUISSE</b>			<b>1 262 785,08</b>	<b>0,43</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>258 136 795,97</b>	<b>86,78</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées</b>			<b>258 136 795,97</b>	<b>86,78</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>				
LBPAM ISR DETTES FINANCIERES FLEXIBLE I	EUR	565	5 811 307,50	1,95
OSTRUM ISR CASH EONIA M	EUR	749	7 378 301,63	2,48
OSTRUM ISR CASH EONIA Part Z2	EUR	78	767 247,00	0,26
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>13 956 856,13</b>	<b>4,69</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
UC AXIOM GL COCO BDS UCITS ETF INS EUR H	EUR	9	1 071 424,62	0,36
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>1 071 424,62</b>	<b>0,36</b>
<b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>			<b>15 028 280,75</b>	<b>5,05</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>15 028 280,75</b>	<b>5,05</b>
<b>Titres mis en dépôt</b>				
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
BNP PARIBAS 2.375% 17-02-25 EMTN	EUR	1 400 000	1 520 377,95	0,51
SOCI GENE 2.5% 16-09-26	EUR	1 500 000	1 537 866,78	0,52
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>3 058 244,73</b>	<b>1,03</b>
<b>TOTAL Titres mis en dépôt</b>			<b>3 058 244,73</b>	<b>1,03</b>
<b>Indemnités sur titres prêtés</b>			35,25	
<b>Titres donnés en pension</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
IKB DEUTSCHE INDUSTRIEBANK AG 4.5% 23-07-22	EUR	500 000	541 542,50	0,18
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>541 542,50</b>	<b>0,18</b>
<b>ESPAGNE</b>				
CAIXABANK 1.375% 19-06-26 EMTN	EUR	1 200 000	1 255 427,67	0,42
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>1 255 427,67</b>	<b>0,42</b>
<b>ETATS-UNIS</b>				
DEUT POST CMS10R+0.125% PERP	EUR	1 100 000	1 074 944,44	0,37
<b>TOTAL ETATS-UNIS</b>			<b>1 074 944,44</b>	<b>0,37</b>
<b>FRANCE</b>				
CAPGEMINI SE 0.625% 23-06-25	EUR	1 400 000	1 435 425,75	0,48
FIN.CREDIT MUTUEL TV 04-PERP.	EUR	1 000 000	955 130,00	0,32
GROUPE DANONE 1.75% PERP EMTN	EUR	2 000 000	2 053 383,02	0,69
UNIBAIL RODAMCO SE 2.125% PERP	EUR	2 800 000	2 820 733,42	0,95
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>7 264 672,19</b>	<b>2,44</b>
<b>IRLANDE</b>				
SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS 2.875% 15-01-26	EUR	849 000	951 463,10	0,32
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>951 463,10</b>	<b>0,32</b>





● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2021 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>ITALIE</b>				
ASSICURAZIONI GENERALI 4.125% 04/05/2026	EUR	1 400 000	1 652 472,93	0,55
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>1 652 472,93</b>	<b>0,55</b>
<b>JAPON</b>				
NISSAN MOTOR 2.652% 17-03-26	EUR	1 502 000	1 649 998,60	0,55
<b>TOTAL JAPON</b>			<b>1 649 998,60</b>	<b>0,55</b>
<b>PORTUGAL</b>				
NOS SGPS 1.125% 02-05-23	EUR	800 000	815 032,11	0,27
<b>TOTAL PORTUGAL</b>			<b>815 032,11</b>	<b>0,27</b>
<b>ROYAUME-UNI</b>				
VODAFONE GROUP 3.1% 03-01-79	EUR	4 199 000	4 445 429,53	1,50
<b>TOTAL ROYAUME-UNI</b>			<b>4 445 429,53</b>	<b>1,50</b>
<b>TOTAL Titres donnés en pension</b>			<b>19 650 983,07</b>	<b>6,60</b>
<b>Dettes représentatives des titres données en pension</b>			<b>-19 611 324,25</b>	<b>-6,59</b>
<b>Indemnités sur titres données en pension</b>			<b>8 356,70</b>	
<b>Instrument financier à terme</b>				
<b>Engagements à terme fermes</b>				
<b>Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé</b>				
FGBL BUND 10A 0921	EUR	-6	-6 660,00	
TU CBOT UST 2 0921	USD	-11	3 623,32	
US 10YR NOTE 0921	USD	-19	-12 892,38	
XEUR FGBM BOB 0921	EUR	-319	-22 330,00	-0,01
XEUR FGBS SCH 0921	EUR	780	-23 400,00	-0,01
<b>TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé</b>			<b>-61 659,06</b>	<b>-0,02</b>
<b>TOTAL Engagements à terme fermes</b>			<b>-61 659,06</b>	<b>-0,02</b>
<b>Autres instruments financiers à terme</b>				
<b>Credit Default Swap</b>				
ALTI FR 3.375 01-28_	EUR	2 900 000	66 090,22	0,03
AUCHAN 2.875 01-26_2	EUR	-1 000 000	-14 623,65	-0,01
HOCH AG 1.75 07-25_2	EUR	1 400 000	255 003,45	0,09
ITRAXX EUR XOVER S35	EUR	-12 000 000	-1 504 457,64	-0,51
UPC HOL 3.875 06-29_	EUR	3 100 000	391 513,42	0,13
ZIGG BO 3.375 02-30_	EUR	2 900 000	68 294,51	0,02
<b>TOTAL Credit Default Swap</b>			<b>-738 179,69</b>	<b>-0,25</b>
<b>TOTAL Autres instruments financiers à terme</b>			<b>-738 179,69</b>	<b>-0,25</b>
<b>TOTAL Instrument financier à terme</b>			<b>-799 838,75</b>	<b>-0,27</b>
<b>Appel de marge</b>				
APPEL MARGE CACEIS	USD	10 992,36	9 269,21	
APPEL MARGE CACEIS	EUR	52 390	52 390,00	0,02
<b>TOTAL Appel de marge</b>			<b>61 659,21</b>	<b>0,02</b>
<b>Créances</b>			<b>16 108 893,88</b>	<b>5,42</b>
<b>Dettes</b>			<b>-14 804 264,11</b>	<b>-4,98</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>794 292,94</b>	<b>0,27</b>
<b>Actif net</b>			<b>297 461 761,46</b>	<b>100,00</b>



## ● INFORMATIONS COMPLÉMENTAIRES SUISSES

*Avertissement : les informations figurant ci-après n'ont pas fait l'objet d'une vérification ou d'une certification de la part du commissaire aux comptes du Fonds.*

### ■ Lieux et adresses des établissements habilités à recevoir les souscriptions et rachats

#### Commercialisateur :

##### **NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL**

43 avenue Pierre Mendès France  
75013 PARIS

#### LES DEMANDES SONT CENTRALISEES CHEZ LE DEPOSITAIRE :

##### **CACEIS BANK**

1-3 place Valhubert  
75013 PARIS

Le règlement, le prospectus et la dernière plaquette périodique peuvent être obtenus auprès du gestionnaire.

Des exemplaires du prospectus complet (comprenant les documents d'informations clés pour l'investisseur (DICI), la note détaillée et le règlement), des rapports annuels et semestriels et de la liste des achats et ventes effectués pour le compte de l'OPC au cours de la période correspondante peuvent être obtenus gratuitement auprès du Représentant et Service de Paiement du FCP en Suisse, RBC Investor Services Bank S.A., Esch-sur-Alzette, succursale de Zurich, Bleicherweg 7, CH-8027 Zurich.



## ● INFORMATIONS COMPLÉMENTAIRES SUISSES (suite)

### ■ LE TOTAL EXPENSE RATIO - TER\* - (non audité)

#### LE TOTAL EXPENSE RATIO - TER\* - (non audité)

TER % = [Charges d'exploitation / Fortune moyenne] x 100

Parts	I	L	GP
Isin	FR0011350677	FR0011350685	FR0013241023
Charges d'exploitation	566 283,42	1 181 053,96	32 687,74
Fortune moyenne du fonds	112 040 205,33	167 514 539,47	5 881 025,17
<b>TER</b>	<b>0,50%</b>	<b>0,70%</b>	<b>0,55%</b>
Commission de surperformance	0,00	0,00	0,00
Fortune moyenne du fonds	112 040 205,33	167 514 539,47	5 881 025,17
<b>TER de surperformance</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>
Frais de fonctionnement et de gestion	<b>0,50%</b>	<b>0,70%</b>	<b>0,55%</b>

Changement taux de frais de gestion sur la période : néant.

\* Le TER présenté a été calculé conformément à la réglementation suisse cf "Directive pour le calcul et la publication du Total Expense Ratio (TER) pour les placements collectifs de capitaux" établie par la Swiss Funds et Asset Management Association SFAMA.

\*\* Dans le cas particulier de classes de parts lancées en cours d'exercice, les TER ont été calculés sur la base des Charges d'exploitation constatées depuis le lancement des classes de parts extrapolées sur une période de 12 mois. La fortune moyenne se calcule sur la base des valeurs de fin de mois de la période sous revue.



## ● INFORMATIONS COMPLÉMENTAIRES SUISSES (suite)

### ■ Les performances annualisées (1 an, 3 ans et 5 ans) au 30/06/2021

**Libellé** **Code Isin** **Devise**  
 OSTRUM ISR OBLI CROSSOVER I FR0011350677 EUR

	Fonds	Indice de référence	Ecart
2015 à 2020	2,01%	2,36%	0,35%
2017 à 2020	0,96%	1,62%	0,67%
2019 à 2020	0,34%	1,60%	1,26%

**Libellé** **Code Isin** **Devise**  
 OSTRUM ISR OBLI CROSSOVER L FR0011350685 EUR

	Fonds	Indice de référence	Ecart
2015 à 2020	1,81%	2,36%	0,56%
2017 à 2020	0,75%	1,62%	0,87%
2019 à 2020	0,14%	1,60%	1,46%

**Libellé** **Code Isin** **Devise**  
 OSTRUM ISR OBLI CROSSOVER GP FR0013241023 EUR

	Fonds	Indice de référence	Ecart
2017 à 2020	0,88%	1,62%	0,75%
2019 à 2020	0,27%	1,60%	1,34%

### Indice de référence

100% BBGB 50€AG500C15YBBB 50€H13YBB

Libellé	Code Isin	Devise	Commentaire
OSTRUM ISR OBLI CROSSOVER I	FR0011350677	EUR	
OSTRUM ISR OBLI CROSSOVER L	FR0011350685	EUR	
OSTRUM ISR OBLI CROSSOVER GP	FR0013241023	EUR	

*La performance historique ne représente pas un indicateur courant ou futur. Les données de performances ne tiennent pas compte des commissions et frais perçus lors de l'émission et du rachat des parts.*

**BILAN ACTIF AU 30/06/2021 EN EUR**

	30/06/2021	31/12/2020
<b>IMMOBILISATIONS NETTES</b>		
<b>DÉPÔTS</b>	<b>19 829 646,07</b>	
<b>INSTRUMENTS FINANCIERS</b>	<b>296 720 523,90</b>	<b>272 769 668,66</b>
<b>Actions et valeurs assimilées</b>		
Négociées sur un marché réglementé ou assimilé		
Non négociées sur un marché réglementé ou assimilé		
<b>Obligations et valeurs assimilées</b>	<b>261 195 040,70</b>	<b>245 170 866,67</b>
Négociées sur un marché réglementé ou assimilé	261 195 040,70	245 170 866,67
Non négociées sur un marché réglementé ou assimilé		
<b>Titres de créances</b>		
Négociés sur un marché réglementé ou assimilé		
Titres de créances négociables		
Autres titres de créances		
Non négociés sur un marché réglementé ou assimilé		
<b>Organismes de placement collectif</b>	<b>15 028 280,75</b>	<b>27 407 815,47</b>
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	15 028 280,75	27 407 815,47
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>Opérations temporaires sur titres</b>	<b>19 651 018,32</b>	
Créances représentatives de titres reçus en pension		
Créances représentatives de titres prêtés	35,25	
Titres empruntés		
Titres donnés en pension	19 650 983,07	
Autres opérations temporaires		
<b>Instruments financiers à terme</b>	<b>846 184,13</b>	<b>190 986,52</b>
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	65 282,53	89 886,21
Autres opérations	780 901,60	101 100,31
<b>Autres instruments financiers</b>		
<b>CRÉANCES</b>	<b>16 108 893,88</b>	<b>18 590 790,46</b>
Opérations de change à terme de devises	13 249 813,30	16 549 636,11
Autres	2 859 080,58	2 041 154,35
<b>COMPTES FINANCIERS</b>	<b>794 292,94</b>	<b>15 850 584,69</b>
Liquidités	794 292,94	15 850 584,69
<b>TOTAL DE L'ACTIF</b>	<b>333 453 356,79</b>	<b>307 211 043,81</b>

**BILAN PASSIF AU 30/06/2021 EN EUR**

	30/06/2021	31/12/2020
<b>CAPITAUX PROPRES</b>		
Capital	295 050 868,68	291 181 435,89
Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées (?)		
Report à nouveau (?)		
Plus et moins-values nettes de l'exercice (?,??)	-334 796,24	-8 255 984,83
Résultat de l'exercice (?,??)	2 745 689,02	5 373 284,89
<b>TOTAL DES CAPITAUX PROPRES *</b>	<b>297 461 761,46</b>	<b>288 298 735,95</b>
<i>* Montant représentatif de l'actif net</i>		
<b>INSTRUMENTS FINANCIERS</b>	<b>21 187 331,22</b>	<b>2 201 596,30</b>
Opérations de cession sur instruments financiers		
Opérations temporaires sur titres	19 602 967,55	
Dettes représentatives de titres donnés en pension	19 602 967,55	
Dettes représentatives de titres empruntés		
Autres opérations temporaires		
Instruments financiers à terme	1 584 363,67	2 201 596,30
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	65 282,38	89 886,36
Autres opérations	1 519 081,29	2 111 709,94
<b>DETTES</b>	<b>14 804 264,11</b>	<b>16 710 711,56</b>
Opérations de change à terme de devises	13 537 793,23	16 466 460,77
Autres	1 266 470,88	244 250,79
<b>COMPTES FINANCIERS</b>		
Concours bancaires courants		
Emprunts		
<b>TOTAL DU PASSIF</b>	<b>333 453 356,79</b>	<b>307 211 043,81</b>



## COMPTE DE RÉSULTAT AU 30/06/2021 EN EUR

	30/06/2021	31/12/2020
<b>Produits sur opérations financières</b>		
Produits sur dépôts et sur comptes financiers	76,82	285,37
Produits sur actions et valeurs assimilées		
Produits sur obligations et valeurs assimilées	3 711 360,14	5 549 999,04
Produits sur titres de créances		1 277,13
Produits sur acquisitions et cessions temporaires de titres	11 237,66	18 573,28
Produits sur instruments financiers à terme		1 135 578,22
Autres produits financiers		
<b>TOTAL (1)</b>	<b>3 722 674,62</b>	<b>6 705 713,04</b>
<b>Charges sur opérations financières</b>		
Charges sur acquisitions et cessions temporaires de titres	1 028,87	4 334,62
Charges sur instruments financiers à terme		
Charges sur dettes financières	19 714,68	53 618,26
Autres charges financières		
<b>TOTAL (2)</b>	<b>20 743,55</b>	<b>57 952,88</b>
<b>RÉSULTAT SUR OPÉRATIONS FINANCIÈRES (1 - 2)</b>	<b>3 701 931,07</b>	<b>6 647 760,16</b>
Autres produits (3)		
Frais de gestion et dotations aux amortissements (4)	910 390,09	1 753 467,34
<b>RÉSULTAT NET DE L'EXERCICE (L. 214-17-1) (1 - 2 + 3 - 4)</b>	<b>2 791 540,98</b>	<b>4 894 292,82</b>
Régularisation des revenus de l'exercice (5)	-45 851,96	478 992,07
Acomptes sur résultat versés au titre de l'exercice (6)		
<b>RÉSULTAT (1 - 2 + 3 - 4 + 5 - 6)</b>	<b>2 745 689,02</b>	<b>5 373 284,89</b>

**CAPITAUX PROPRES****Nombre de titres émis ou rachetés**

	En parts	En montant
<b>Ostrum ISR OBLI CROSSOVER GP</b>		
Parts souscrites durant l'exercice	7 463,74596	789 553,48
Parts rachetées durant l'exercice	-5 235,08009	-553 628,08
Solde net des souscriptions/rachats	2 228,66587	235 925,40
Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	64 384,19662	
<b>Ostrum ISR OBLI CROSSOVER I</b>		
Parts souscrites durant l'exercice	722,36023	8 901 446,73
Parts rachetées durant l'exercice	-1 518,35736	-18 743 872,30
Solde net des souscriptions/rachats	-795,99713	-9 842 425,57
Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	9 680,52018	
<b>Ostrum ISR OBLI CROSSOVER L</b>		
Parts souscrites durant l'exercice	29 199,90588	35 468 115,37
Parts rachetées durant l'exercice	-16 187,09296	-19 681 283,84
Solde net des souscriptions/rachats	13 012,81292	15 786 831,53
Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	139 913,31924	





**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