



NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

OPCVM de droit français (SICAV)

OSTRUM SRI EURO SOVEREIGN BONDS

RAPPORT SEMESTRIEL

au 29 septembre 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	427 576 700,00
b) Avoirs bancaires	0,00
c) Autres actifs détenus par l'OPC	251 550 486,26
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	679 127 186,26
e) Passif	-136 554 124,43
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	542 573 061,83

* Les montants sont signés

• NOMBRE D'ACTIONS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR ACTION

Action	Type d'action	Actif net par action	Nombre d'actions en circulation	Valeur nette d'inventaire par action
OSTRUM SRI EURO SOVEREIGN BONDS R(C) en EUR	C	213 564 347,45	464 394,0824	459,87
OSTRUM SRI EURO SOVEREIGN BONDS R(D) en EUR	D	9 920 302,67	35 585,5301	278,77
OSTRUM SRI EURO SOVEREIGN BONDS I(C) en EUR	C	118 212 630,52	836,5041	141 317,45
OSTRUM SRI EURO SOVEREIGN BONDS N en EUR	C	13 871 658,58	15 260,3834	908,99
OSTRUM SRI EURO SOVEREIGN BONDS SN(C) en EUR	C	187 002 441,65	208 398,7724	897,32
OSTRUM SRI EURO SOVEREIGN BONDS UNICREDIT en EUR	C	1 680,96	1,8502	908,52

**● 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.	78,58	62,78
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	0,23	0,18
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.	4,68	3,74

* 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	425 373 451,43	78,40	62,64
Dollar Us	USD	1 146 801,12	0,21	0,17
Livre Sterling	GBP	1 056 447,45	0,19	0,16
TOTAL		427 576 700,00	78,81	62,96

* 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	27,93	22,32
ITALIE	19,30	15,42
ALLEMAGNE	11,28	9,02
ESPAGNE	9,27	7,41
BELGIQUE	4,48	3,58
AUTRICHE	1,98	1,58
FINLANDE	1,31	1,04
IRLANDE	1,11	0,89
PAYS-BAS	0,86	0,69
GRECE	0,59	0,47
LUXEMBOURG	0,46	0,37
ETATS-UNIS	0,21	0,17
ROYAUME-UNI	0,01	0,01
TOTAL	78,81	62,96

* 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	4,68	3,74
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	4,68	3,74

* 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.	600 944 651,05	391 392 294,98
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	0,00	0,00
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	43 693 227,57	36 432 765,04

● DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Action	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
Dividendes versés				
19/07/2023	OSTRUM SRI EURO SOVEREIGN BONDS R(D)	2,46	0,00	2,46
Dividendes à verser				
	OSTRUM SRI EURO SOVEREIGN BONDS R(D)			

● INFORMATIONS DIVERSES

Etablissement dépositaire : Caceis Bank - 12 place des États-Unis - CS 40083 - 92549 - Montrouge Cedex

Le relevé Périodicité Semestrielle détaillé de l'actif est disponible dans un délai de huit semaines à compter de la fin de la période. Il peut être transmis sur simple demande auprès de la société de gestion :

Natixis Investment Managers International - 43 avenue Pierre Mendès France - 75013 - Paris



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

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

a) Titres et matières premières prêtés

Montant	6 640 807,08				
% de l'Actif Net*	1,24%				

*% 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	6 640 807,08	0,00	90 348 447,04	0,00	0,00
% de l'Actif Net	1,22%	0,00	16,65%	0,00	0,00

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

TELEFONICA DE ESPANA SA ESPAGNE	1 331 597,68			0,00	0,00
AUSTRIA GOVERNMENT BOND AUTRICHE	1 210 310,08			0,00	0,00
UNITED STATES TREAS INFLATION IND BONDS ETATS-UNIS	1 134 599,84			0,00	0,00
BANQUE EUROPEENNE D'INVESTISSEMENT LUXEMBOURG	1 034 374,09			0,00	0,00
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA ESPAGNE	1 017 410,70			0,00	0,00
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT FRANCE	872 599,00			0,00	0,00
AMADEUS IT GROUP SA ESPAGNE	441 227,84			0,00	0,00
IBERDROLA SA ESPAGNE	128 994,13			0,00	0,00
AIRBUS SE FRANCE	85 711,50			0,00	0,00
EUROPEAN UNION BELGIQUE	80 780,28			0,00	0,00

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

NATIXIS ASSET MANAGEMENT FINANCE FRANCE	6 640 807,08	0,00	79 725 925,66	0,00	0,00
CACEIS BANK (FRANCE) FRANCE	0,00	0,00	10 622 521,38	0,00	0,00



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

e) Type et qualité des garanties (collatéral)

Type					
- Actions	3 142 750,51			0,00	0,00
- Obligations	4 442 785,73			0,00	0,00
- OPC	0,00			0,00	0,00
- TCN	0,00			0,00	0,00
- Cash	85 636,67		93 068 261,72		0,00
Rating	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

Monnaie de la garantie					
Livre Sterling	1 056 447,45		0,00	0,00	0,00
Euro	5 467 924,34		93 068 261,72	0,00	0,00
Dollar Us	1 146 801,12		0,00	0,00	0,00

f) Règlement et compensation des contrats

Triparties				X	
Contrepartie centrale					
Bilatéraux	X			X	

g) Échéance de la garantie ventilée en fonction des tranches

Moins d'1 jour	0,00			0,00	0,00
1 jour à 1 semaine	0,00			0,00	0,00
1 semaine à 1 mois	0,00			0,00	0,00
1 à 3 mois	979 120,92			0,00	0,00
3 mois à 1 an	0,00			0,00	0,00
Plus d'1 an	2 377 705,83			0,00	0,00
Ouvertes	4 228 709,49			0,00	0,00



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

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

Moins d'1 jour	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
1 jour à 1 semaine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
1 semaine à 1 mois	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
1 à 3 mois	0,00	0,00	15 111 600,00	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	6 640 807,08	0,00	75 236 847,04	0,00	0,00

i) Données sur la réutilisation des garanties

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

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

Caceis Bank					
Titres	7 585 536,24			0,00	0,00
Cash	85 636,67				0,00

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

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

l) Données sur les revenus et les coûts ventilés

Revenus					
- OPC	8 276,60	0,00	22 704,34	0,00	
- Gestionnaire	0,00	0,00	0,00	0,00	
- Tiers	0,00	0,00	0,00	0,00	
Coûts					
- OPC	4 831,78	0,00	1 036 622,55	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.

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 29/09/2023 EN EUR**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Dépôts				
Collat. espèces p/e	EUR	88 123 773,71	88 347 252,58	16,28
TOTAL Dépôts			88 347 252,58	16,28
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
ALLEMAGNE 2.5% 04/07/2044	EUR	200 000	185 401,17	0,03
BUND DE 0.0 08-30	EUR	4 500 000	3 752 325,00	0,70
BUND DE 0.0 08-50	EUR	4 760 000	2 192 884,40	0,40
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 0.0% 15-08-52	EUR	100 000	43 145,00	0,01
BUNDSOBLIGATION 1.3% 15-10-27	EUR	27 150 000	26 103 192,70	4,81
KRED FU 0.0 09-28	EUR	14 000 000	11 904 340,00	2,20
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU KFW 3.125% 07-06-30	EUR	7 300 000	7 285 218,50	1,34
REPU FE 1.0 05-38	EUR	6 400 000	4 931 087,74	0,90
REPU FE 1.8 08-53	EUR	6 300 000	4 816 096,97	0,89
TOTAL ALLEMAGNE			61 213 691,48	11,28
AUTRICHE				
AUST GO 0.0 02-31	EUR	2 600 000	2 043 392,00	0,37
AUST GO 0.0 10-40	EUR	1 000 000	544 140,00	0,10
AUST GO 0.75 03-51	EUR	2 730 000	1 400 290,40	0,26
AUST GO 2.1 09-17	EUR	1 000	628,85	0,00
AUST GO 2.9 05-29	EUR	4 000 000	3 991 371,64	0,74
AUST GOVE BON 3.8% 26-01-62	EUR	480 000	507 171,55	0,09
AUST GOVE BON 4.15% 15-03-37	EUR	850 000	915 802,22	0,17
AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.85% 30-06-20	EUR	300 000	105 364,89	0,02
TOTAL AUTRICHE			9 508 161,55	1,75
BELGIQUE				
BELG GO 1.25 04-33	EUR	1 800 000	1 503 667,97	0,28
BELG GO 1.4 06-53	EUR	6 400 000	3 631 039,30	0,67
BELG GO 2.75 04-39	EUR	1 800 000	1 607 296,33	0,30
BELGIQUE 4.25% 03/41	EUR	220 000	236 739,08	0,04
BELGIUM 2.15% 22-06-66	EUR	350 000	232 158,69	0,04
BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.25% 22-06-57	EUR	600 000	421 249,18	0,08
EUROPEAN UNION 0.0% 04-10-28	EUR	10 100 000	8 564 800,00	1,57
EURO UN 1.625 12-29	EUR	5 000 000	4 589 198,63	0,85
EURO UN 3.125 12-30	EUR	3 500 000	3 444 065,21	0,63
TOTAL BELGIQUE			24 230 214,39	4,46
ESPAGNE				
ROYA DSPA 1.95% 30-07-30	EUR	12 000 000	10 851 757,38	2,00
SECRETARA GENERAL DEL TESORO 1.2% 31-10-40	EUR	600 000	384 125,67	0,08
SPAI GO 0.0 01-28	EUR	11 000 000	9 490 140,00	1,75
SPAI GO 0.0 05-25	EUR	5 500 000	5 188 480,00	0,95
SPAI GO 0.85 07-37	EUR	2 400 000	1 578 694,95	0,29
SPAI GO 1.0 07-42	EUR	542 000	313 794,13	0,06
SPAI GO 1.9 10-52	EUR	4 659 000	2 803 890,87	0,52
SPAI GO 3.15 04-33	EUR	6 000 000	5 741 677,38	1,06
SPAI GO 3.45 07-66	EUR	600 000	481 696,23	0,09



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/09/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SPAI GO 3.55 10-33	EUR	7 200 000	7 061 730,41	1,30
SPAI GO 4.7 07-41	EUR	750 000	792 185,25	0,15
SPAIN GOVERNMENT BOND 0.5% 31-10-31	EUR	3 000 000	2 351 659,32	0,43
SPAIN GOVERNMENT BOND 1.45% 31-10-71	EUR	820 000	348 801,49	0,06
TOTAL ESPAGNE			47 388 633,08	8,74
FINLANDE				
FINLAND GOVERNMENT BOND 0.125% 15-09-31	EUR	8 500 000	6 628 992,54	1,22
FINLAND GOVERNMENT BOND 0.25% 15-09-40	EUR	800 000	462 466,36	0,09
TOTAL FINLANDE			7 091 458,90	1,31
FRANCE				
BPIFRANCE 3.0% 10-09-26 EMTN	EUR	4 000 000	3 950 300,98	0,73
BPIFRANCE 3.125% 25-05-33 EMTN	EUR	2 000 000	1 939 894,97	0,36
BPI FRANCE E 0.0% 25-05-28	EUR	1 900 000	1 621 992,00	0,30
CADES 0.0% 25-02-28	EUR	4 000 000	3 449 320,00	0,64
CADES 2.875% 25-05-27 EMTN	EUR	6 100 000	6 045 406,83	1,12
CADES 3.0% 25-05-28 EMTN	EUR	8 200 000	8 138 973,18	1,50
CADES 3.0% 25-11-31 EMTN	EUR	6 100 000	5 938 609,88	1,09
CADES 3.125% 01-03-30 EMTN	EUR	4 000 000	4 003 290,49	0,73
FRAN GO 0.0 02-25	EUR	36 700 000	34 991 615,00	6,45
FRAN GO 0.0 05-32	EUR	799 999	604 463,24	0,11
FRAN GO 0.5 06-44	EUR	8 800 000	4 726 621,86	0,87
FRAN GO 0.75 02-28	EUR	43 600 000	39 577 487,89	7,30
FRAN GO 0.75 05-53	EUR	20 700 000	9 578 395,62	1,76
FRAN GO 1.25 05-38	EUR	9 900 000	7 253 275,03	1,34
FRAN GO 1.75 06-39	EUR	3 100 000	2 421 941,40	0,44
FRAN GO 2.0 11-32	EUR	5 400 000	4 930 393,81	0,91
FRAN GOVE BON 1.25% 25-05-36	EUR	5 000 000	3 852 620,22	0,71
FRENCH REP 2.25% 25-05-24	EUR	7 455 297	7 445 778,66	1,37
TOTAL FRANCE			150 470 381,06	27,73
GRECE				
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 4.25% 15-06-33	EUR	748 000	752 999,05	0,15
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 4.375% 18-07-38	EUR	2 500 000	2 459 535,59	0,45
TOTAL GRECE			3 212 534,64	0,60
IRLANDE				
IREL GO 1.35 03-31	EUR	5 300 000	4 712 389,87	0,87
IREL GO 3.0 10-43	EUR	1 400 000	1 315 718,08	0,24
TOTAL IRLANDE			6 028 107,95	1,11
ITALIE				
BTPS 4 3/4 09/01/44	EUR	1 500 000	1 446 383,74	0,27
ITAL BU 0.0 04-26	EUR	16 000 000	14 520 480,00	2,67
ITAL BU 0.25 03-28	EUR	2 900 000	2 453 033,52	0,45
ITAL BU 0.9 04-31	EUR	6 700 000	5 206 899,51	0,96
ITAL BU 0.95 09-27	EUR	1 000 000	889 809,78	0,16
ITAL BU 2.15 09-52	EUR	17 200 000	9 820 341,89	1,81
ITAL BU 2.45 09-50	EUR	30 000	18 831,42	0,00
ITAL BU 3.7 06-30	EUR	5 000 000	4 860 201,09	0,90
ITAL BU 3.8 08-28	EUR	13 600 000	13 484 881,91	2,49



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/09/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ITAL BU 4.0 02-37	EUR	100 000	92 447,78	0,02
ITAL BU 4.5 10-53	EUR	4 350 000	3 918 331,67	0,72
ITALIE 5%09-010940	EUR	2 800 000	2 807 855,69	0,51
ITALY 5% 08/34	EUR	2 850 000	2 928 003,88	0,54
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.45% 01-03-36	EUR	500 000	344 547,36	0,07
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.15% 01-03-72	EUR	500 000	256 000,05	0,05
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.4% 28-03-25	EUR	42 000 000	41 659 255,38	7,68
TOTAL ITALIE			104 707 304,67	19,30
LUXEMBOURG				
BANQUE EUROPEAN D INVESTISSEMENT 2.75% 30-07-30	EUR	1 500 000	1 454 030,82	0,26
TOTAL LUXEMBOURG			1 454 030,82	0,26
PAYS-BAS				
NETHERLAND 4% 15-01-37	EUR	800 000	885 082,19	0,17
NETHERLANDS GOVERNMENT 2.0% 15-01-54	EUR	1 600 000	1 240 802,19	0,23
NETH GO 0.5 01-40	EUR	3 900 000	2 560 760,84	0,47
TOTAL PAYS-BAS			4 686 645,22	0,87
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			419 991 163,76	77,41
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			419 991 163,76	77,41
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
OSTRUM SRI CASH M	EUR	724	7 283 367,60	1,34
OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3 I	EUR	2 530,36	7 797 810,41	1,44
OSTRUM SUSTAINABLE EURO SOVEREIGN 1-3	EUR	1 205,988	3 586 089,74	0,66
TOTAL FRANCE			18 667 267,75	3,44
LUXEMBOURG				
OSTRUM EURO BDS OPP 12M SI A EUR CAP	EUR	20 000	1 920 600,00	0,36
OSTRUM EURO INFLATION IA 4D	EUR	99 999,9974	4 784 999,88	0,88
TOTAL LUXEMBOURG			6 705 599,88	1,24
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			25 372 867,63	4,68
TOTAL Organismes de placement collectif			25 372 867,63	4,68
Titres reçus en garantie				
Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
AIRBUS SE	EUR	675	85 711,50	0,01
AMADEUS IT GROUP SA	EUR	7 703	441 227,84	0,08
IBERDROLA SA	EUR	12 175	128 994,13	0,03
INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL	EUR	28 830	1 017 410,70	0,18
L'OREAL	EUR	68	26 737,60	0,01
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUI	EUR	69	49 431,60	0,01
TELEFONICA SA	EUR	344 260	1 331 597,68	0,25
THYSSENKRUPP AG	EUR	2 163	15 629,84	0,00
VIVENDI	EUR	5 546	46 009,62	0,01
TOTAL Actions et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			3 142 750,51	0,58
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
AUST GO 0.75 02-28	EUR	1 323 000	1 198 615,89	0,22



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/09/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
AUST GO 4.85 03-26	EUR	11 000	11 694,19	0,00
BANQUE EUROPEAN D'INVESTISSEMENT 0.875% 15-12-23	GBP	851 000	979 120,92	0,18
BANQUE EUROPEAN D'INVESTISSEMENT 2.75% 30-07-30	EUR	57 000	55 253,17	0,01
EUROPEAN FINL STABILITY FACIL 0.4% 26-01-26	EUR	22 000	20 594,63	0,00
EUROPEAN UNION 0.0% 04-07-31	EUR	104 753	80 780,28	0,02
FRAN GO 0.5 06-44	EUR	1 603 531	861 282,35	0,16
FRAN GO 0.75 11-28	EUR	12 645	11 316,65	0,00
INTEL 4.875% 10-02-26	USD	16 000	12 201,28	0,00
UNITED KINGDOM GILT 4.25% 07-12-40	GBP	70 452,2	77 326,53	0,02
UNITED STATES TREAS INFLATION BONDS 0.125% 15-07-26	USD	1 006 900	1 134 599,84	0,21
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			4 442 785,73	0,82
TOTAL Titres reçus en garantie			7 585 536,24	1,39
Dettes représentatives des titres reçus en garantie			-7 558 867,75	-1,39
Créance représentative de titres prêtés				
FRANCE				
FRAN GO 1.75 06-39	EUR	8 500 000	6 640 807,08	1,23
TOTAL FRANCE			6 640 807,08	1,23
TOTAL Créance représentative de titres prêtés			6 640 807,08	1,23
Indemnités sur titres prêtés			484,78	0,00
Titres donnés en pension				
ALLEMAGNE				
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU KFW 3.125% 07-06-30	EUR	7 400 000	7 385 016,01	1,36
TOTAL ALLEMAGNE			7 385 016,01	1,36
AUTRICHE				
AUST GO 2.1 09-17	EUR	209 000	131 428,79	0,02
TOTAL AUTRICHE			131 428,79	0,02
BELGIQUE				
EUROPEAN UNION 0.0% 04-10-28	EUR	12 300 000	10 430 400,00	1,93
TOTAL BELGIQUE			10 430 400,00	1,93
ESPAGNE				
SPAI GO 1.9 10-52	EUR	10 001 000	6 018 826,48	1,11
TOTAL ESPAGNE			6 018 826,48	1,11
FRANCE				
BPI FRANCE E 0.0% 25-05-28	EUR	10 200 000	8 707 536,00	1,61
CADES 2.875% 25-05-27 EMTN	EUR	5 900 000	5 847 196,77	1,07
FRAN GO 0.0 05-32	EUR	26 000 001	19 645 080,76	3,62
FRENCH REP 2.25% 25-05-24	EUR	3 044 703	3 040 815,76	0,56
TOTAL FRANCE			37 240 629,29	6,86
GRECE				
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 4.25% 15-06-33	EUR	10 552 000	10 622 521,38	1,96
TOTAL GRECE			10 622 521,38	1,96
ITALIE				
ITAL BU 4.0 02-37	EUR	10 300 000	9 522 121,61	1,75
ITAL BU 4.4 05-33	EUR	9 000 000	8 997 503,48	1,66
TOTAL ITALIE			18 519 625,09	3,41
TOTAL Titres donnés en pension			90 348 447,04	16,65
Dettes représentatives des titres données en pension			-92 817 636,51	-17,11



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 29/09/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Indemnités sur titres données en pension			-250 625,21	-0,05
Instrument financier à terme				
Engagements à terme fermes				
Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé				
EURO BOBL 1223	EUR	-202	-133 320,00	-0,03
EURO BUND 1223	EUR	-72	-75 960,00	-0,01
EURO-OAT 1223	EUR	-268	-161 810,00	-0,03
EURO SCHATZ 1223	EUR	1 136	84 260,00	0,02
XEUR FGBX BUX 1223	EUR	32	-42 240,00	-0,01
TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé			-329 070,00	-0,06
TOTAL Engagements à terme fermes			-329 070,00	-0,06
TOTAL Instrument financier à terme			-329 070,00	-0,06
Appel de marge				
APPEL MARGE CACEIS	EUR	329 069,97	329 069,97	0,06
TOTAL Appel de marge			329 069,97	0,06
Opérations de cessions sur instruments financiers				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ITAL BU 4.4 05-33	EUR	-600 000	-599 833,57	-0,11
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			-599 833,57	-0,11
TOTAL Opérations de cessions sur instruments financiers			-599 833,57	-0,11
Créances			40 427 297,18	7,45
Dettes			-34 600 963,33	-6,37
Comptes financiers			-312 868,06	-0,06
Actif net			542 573 061,83	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