



**NATIXIS INVESTMENT
MANAGERS INTERNATIONAL**

OPCVM de droit français

OSTRUM SRI MONEY PLUS

RAPPORT SEMESTRIEL

au 28 décembre 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	11 140 583 695,34
b) Avoirs bancaires	445 031 129,88
c) Autres actifs détenus par l'OPC	1 314 228 422,88
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	12 899 843 248,10
e) Passif	-8 544 504,69
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	12 891 298 743,41

* Les montants sont signés

• NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART

Part	Type de part	Actif net par part	Nombre de parts en circulation	Valeur nette d'inventaire par part
OSTRUM SRI MONEY PLUS I(C) en EUR	C	11 001 622 096,28	103 899,0315	105 887,62
OSTRUM SRI MONEY PLUS I(D) en EUR	D	27 619 445,35	277,6127	99 489,12
OSTRUM SRI MONEY PLUS M(C) en EUR	C	925 044 933,80	8 994,5000	102 845,62
OSTRUM SRI MONEY PLUS N(C) en EUR	C	178 597 841,98	17 333,8538	10 303,41
OSTRUM SRI MONEY PLUS R(C) en EUR	C	758 414 426,00	71 953,5943	10 540,32



● 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.	75,51	75,46
C) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la cote officielle d'une bourse de valeurs d'un pays tiers ou négociés sur un autre marché d'un pays tiers, réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu et ouvert au public, pour autant que cette bourse ou ce marché ne figure pas sur une liste établie par l'Autorité des marchés financiers ou que le choix de cette bourse ou de ce marché soit prévu par la loi ou par le règlement ou les statuts de l'organisme de placement collectif en valeurs mobilières.	10,91	10,91
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.	9,94	9,93

* 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	11 140 583 695,34	86,42	86,36
TOTAL		11 140 583 695,34	86,42	86,36

* 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	36,98	36,96
LUXEMBOURG	12,33	12,32
ESPAGNE	7,97	7,96
PAYS-BAS	6,47	6,47
ROYAUME-UNI	6,45	6,45
ALLEMAGNE	3,41	3,41
ITALIE	3,30	3,30
CANADA	3,21	3,21
IRLANDE	2,97	2,97
SUEDE	0,94	0,94
FINLANDE	0,89	0,89
ETATS-UNIS	0,60	0,60
PORTUGAL	0,41	0,41
BELGIQUE	0,38	0,38
JAPON	0,10	0,10
TOTAL	86,42	86,36

* 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	9,94	9,93
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	9,94	9,93

* 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.	10 709 437 861,90	12 158 542 774,80
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.	1 318 579 907,46	1 695 603 150,00
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.	731 488 259,85	871 025 438,85

• DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
Dividendes versés				
17/09/2023	OSTRUM SRI MONEY PLUS I(D)	1 589,20	0,00	1 589,20
Dividendes à verser				
	OSTRUM SRI MONEY PLUS I(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

**• INFORMATION SUR LES FRAIS DE GESTION VARIABLES**

	28/12/2023
Parts OSTRUM SRI MONEY PLUS I(C)	
Frais de gestion variables provisionnés	2 335 482,07
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,02
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Parts OSTRUM SRI MONEY PLUS I(D)	
Frais de gestion variables provisionnés	6 705,15
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,02
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Parts OSTRUM SRI MONEY PLUS M(C)	
Frais de gestion variables provisionnés	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,00
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Parts OSTRUM SRI MONEY PLUS N(C)	
Frais de gestion variables provisionnés	61 216,63
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,02
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00
Parts OSTRUM SRI MONEY PLUS R(C)	
Frais de gestion variables provisionnés	61 997,58
Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés	0,01
Frais de gestion variables acquis	0,00
Pourcentage de frais de gestion variables acquis	0,00

« Le montant des frais de gestion variables affiché ci-dessus correspond à la somme des provisions et reprises de provisions ayant impacté l'actif net au cours de la période sous revue. »



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

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

a) Titres et matières premières prêtés

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

*% hors trésorerie et équivalent de trésorerie

b) Actifs engagés pour chaque type d'opérations de financement sur titres et TRS exprimés en valeur absolue

Montant	0,00	0,00	0,00	24 712 695,00	0,00
% de l'Actif Net	0,00	0,00	0,00	0,19%	0,00

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

ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO ITALIE	0,00			24 712 695,00	0,00
---	------	--	--	---------------	------

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

NATIXIS FRANCE	0,00	0,00	0,00	24 712 695,00	0,00
-------------------	------	------	------	---------------	------

e) Type et qualité des garanties (collatéral)

Type					
- Actions	0,00			0,00	0,00
- Obligations	0,00			24 712 695,00	0,00
- OPC	0,00			0,00	0,00
- TCN	0,00			0,00	0,00
- Cash	0,00		0,00		0,00
Rating	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

Monnaie de la garantie					
Euro	0,00		0,00	24 712 695,00	0,00

f) Règlement et compensation des contrats

Triparties				X	
Contrepartie centrale					
Bilatéraux	X			X	



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

g) Échéance de la garantie ventilée en fonction des tranches

Moins d'1 jour	0,00			0,00	0,00
1 jour à 1 semaine	0,00			0,00	0,00
1 semaine à 1 mois	0,00			0,00	0,00
1 à 3 mois	0,00			0,00	0,00
3 mois à 1 an	0,00			0,00	0,00
Plus d'1 an	0,00			0,00	0,00
Ouvertes	0,00			24 712 695,00	0,00

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

Moins d'1 jour	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
1 jour à 1 semaine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
1 semaine à 1 mois	0,00	0,00	0,00	24 712 695,00	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					
Titres	0,00			24 712 695,00	0,00
Cash	0,00				0,00

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

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



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

l) Données sur les revenus et les coûts ventilés

Revenus					
- OPC	0,00	0,00	0,00	843 071,94	
- 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	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 28/12/2023 EN EUR**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
BELGIQUE				
ANHEUSER INBEV SANV E3R+0.3% 15-04-24	EUR	11 487 000	11 593 811,55	0,09
TOTAL BELGIQUE			11 593 811,55	0,09
CANADA				
BANK OF NOVA SCOTIA E3R+0.5% 22-09-25	EUR	31 000 000	31 063 116,00	0,25
BANK OF NOVA SCOTIA E3R+0.52% 12-12-25	EUR	20 000 000	20 055 133,33	0,16
BANK OF NOVA SCOTIA TORONTO E3R+0.75% 01-02-24	EUR	30 000 000	30 241 805,00	0,24
CAN IMP BK E3R+0.5% 09-06-25	EUR	20 000 000	20 069 607,22	0,15
CAN IMP BK OISEST+0.4% 05-04-24	EUR	48 000 000	48 493 866,24	0,37
DAIMLER TRUCKS FINANCE CANADA E3R+0.5% 18-03-25	EUR	50 000 000	50 121 055,56	0,39
DAIMLER TRUCKS FINANCE CANADA E3R+0.5% 18-03-25	EUR	30 000 000	30 082 533,33	0,24
FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS QUEBEC E3R+0.3% 27-09-24	EUR	55 000 000	55 060 341,11	0,42
NATL BANK OF CANADA E3R+0.65% 21-04-25	EUR	30 000 000	30 391 460,00	0,24
NATL BANK OF CANADA E3R+0.75% 01-02-24	EUR	55 800 000	56 246 409,30	0,43
ROYAL BANK OF CANADA TORONTO E3R+0.75% 31-01-24	EUR	25 000 000	25 202 725,00	0,19
THE BANK OF NOVA SCOTIA OISEST+0.4% 18-04-24	EUR	16 900 000	17 050 476,34	0,13
TOTAL CANADA			414 078 528,43	3,21
ESPAGNE				
BANCO NTANDER E3R+0.55% 16-01-25	EUR	56 700 000	57 396 016,13	0,44
BANCO NTANDER E3R+1.0% 05-05-24	EUR	20 100 000	20 308 731,80	0,16
BBVA E3R+0.7% 11-07-24 EMTN	EUR	75 000 000	75 955 500,00	0,59
Santander Consumer Finance E3R+0.48% 14-03-25	EUR	68 000 000	68 177 767,11	0,53
TOTAL ESPAGNE			221 838 015,04	1,72
FINLANDE				
OP CORPORATE BANK E3R+0.48% 21-11-25	EUR	65 000 000	65 396 370,00	0,50
TOTAL FINLANDE			65 396 370,00	0,50
FRANCE				
ALD E3R+0.55% 21-02-25 EMTN	EUR	50 000 000	50 368 497,22	0,40
ALD E3R+0.65% 06-10-25 EMTN	EUR	23 300 000	23 601 810,08	0,18
BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL BFCM E3R+0.38% 08-09-25	EUR	43 000 000	43 158 048,89	0,34
BNP PAR 1.375% 02-06-25 EMTN	EUR	10 000 000	9 768 077,76	0,07
BPCE E3R+0.33% 06-09-24 EMTN	EUR	25 000 000	25 082 322,22	0,19
SG OISEST+0.03% 05-02-24 EMTN	EUR	250 000 000	257 787 990,56	2,00
VILOGIA STE ANONYME D HLM E3R+0.45% 04-09-24	EUR	15 000 000	15 063 490,00	0,11
TOTAL FRANCE			424 830 236,73	3,29
IRLANDE				
CA AUTO BANK SPA IRISH BRANCH E3R+0.85% 13-01-25	EUR	75 000 000	76 001 816,67	0,59
FCA BANK E3R+1.6% 24-03-24	EUR	44 000 000	44 127 301,78	0,35
TOTAL IRLANDE			120 129 118,45	0,94
ITALIE				
INTE E3R+0.63% 17-03-25 EMTN	EUR	108 431 000	108 723 462,50	0,84
TOTAL ITALIE			108 723 462,50	0,84



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 28/12/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
JAPON				
MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP 2.264% 14-06-25	EUR	12 500 000	12 542 950,14	0,10
TOTAL JAPON			12 542 950,14	0,10
LUXEMBOURG				
PURPLE PROTECTED ASSET OISEST+0.05% 18-10-24	EUR	150 000 000	151 173 547,17	1,18
PURPLE PROTECTED ASSET OISEST+0.05% 18-11-24	EUR	400 000 000	401 804 259,67	3,12
PURPLE PROTECTED ASSET OISEST+0.08% 17-12-24	EUR	63 000 000	63 293 329,68	0,49
SG ISSUER OISEST+0.03% 02-05-24	EUR	100 000 000	102 448 220,00	0,79
SG ISSUER OISEST+0.03% 17-06-24	EUR	100 000 000	102 047 575,83	0,79
SG ISSUER OISEST+0.03% 27-02-24	EUR	350 000 000	360 326 208,67	2,79
TRATON FINANCE LUXEMBOURG 4.125% 18-01-25	EUR	60 500 000	63 063 791,09	0,49
TRATON FINANCE LUXEMBOURG E3R+0.95% 18-09-25	EUR	43 000 000	43 090 132,78	0,34
TRATON FINANCE LUXEMBOURG E3RJ+0.85% 17-02-24	EUR	50 000 000	50 288 838,89	0,39
TOTAL LUXEMBOURG			1 337 535 903,78	10,38
PAYS-BAS				
DE VOLKSBANK NV E3R+0.55% 12-09-24	EUR	50 000 000	50 221 500,00	0,39
HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV E3R+0.55% 19-01-24	EUR	59 400 000	59 860 515,00	0,47
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0.33% 29-11-24	EUR	33 500 000	33 615 862,54	0,26
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0.43% 22-12-25	EUR	44 000 000	44 065 750,67	0,34
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 3.75% 25-11-24	EUR	68 000 000	68 102 758,03	0,53
TOTAL PAYS-BAS			255 866 386,24	1,99
ROYAUME-UNI				
BARCLAYS BK E3R+0.42% 03-05-24	EUR	45 000 000	46 884 902,50	0,36
BARCLAYS BK OISEST+0.46% 22-11-24	EUR	100 000 000	100 452 795,00	0,78
TOTAL ROYAUME-UNI			147 337 697,50	1,14
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			3 119 872 480,36	24,20
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			3 119 872 480,36	24,20
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
CONTINENTAL AG 031224 FIX 0.0	EUR	50 000 000	48 335 767,31	0,38
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 1101	EUR	25 000 000	24 962 710,50	0,19
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 190124 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 983 145,07	0,06
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 220124 FIX 0.0	EUR	18 500 000	18 449 103,84	0,14
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 290124 FIX 0.0	EUR	14 000 000	13 950 269,69	0,11
FRESENIUS SE 210324 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 857 605,25	0,12
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU KFW 080424 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 948 053,41	0,04
SANTANDER CONSUMER BANK AG 030124 FIX 0.0	EUR	107 000 000	106 941 525,27	0,83
SANTANDER CONSUMER BANK AG 260424 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 356 243,50	0,38
SCHAEFFLER AG 260124 FIX 0.0	EUR	21 000 000	20 932 485,06	0,16
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 150124 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 904 604,58	0,38
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 291223	EUR	50 000 000	50 000 000,00	0,39
VOLKSWAGEN LEASING GMBH 070324 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 770 045,50	0,23
TOTAL ALLEMAGNE			439 391 558,98	3,41

**• PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 28/12/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BELGIQUE				
BARRY CALLEBAUT SERVICES NV 150124 FIX 0	EUR	14 000 000	13 972 346,24	0,11
BARRY CALLEBAUT SERVICES NV 230124 FIX 0	EUR	4 000 000	3 988 388,53	0,03
BARRY CALLEBAUT SERVICES NV 291223 FIX 0.0	EUR	7 000 000	7 000 000,00	0,05
COFINIMMO SA 060324 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 955 250,00	0,04
COFINIMMO SA 070324 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 962 138,59	0,04
COMMUNAUTE FRANCAISE BELGIQUE 290124 FIX	EUR	1 250 000	1 245 691,26	0,01
TOTAL BELGIQUE			37 123 814,62	0,28
ESPAGNE				
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 07102	EUR	80 000 000	77 693 238,75	0,60
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 09092	EUR	75 000 000	73 013 515,21	0,57
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 140324 FIX 0.0	EUR	75 000 000	74 359 003,09	0,58
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 170624 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 064 442,88	0,38
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 300424 FIX 0.0	EUR	107 000 000	105 538 315,44	0,82
BANCO SANTANDER SA 020924 FIX 0.0	EUR	45 000 000	43 842 750,15	0,34
BANCO SANTANDER SA 041124 FIX 0.0	EUR	50 000 000	48 436 183,59	0,37
BANCO SANTANDER SA 230824 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 504 208,44	0,15
BANCO SANTANDER SA 310524 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 170 170,33	0,38
BANC SANT ALL SPAI ZCP 04-12-24	EUR	20 000 000	19 322 630,74	0,15
BBVA ZCP 19-07-24	EUR	100 000 000	97 817 068,65	0,76
BBVA ZCP 22-05-24	EUR	30 000 000	29 520 866,50	0,23
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A. 120324 FIX 0.0	EUR	77 000 000	76 378 156,21	0,60
Santander Consumer Finance S.A. 201124 F	EUR	43 000 000	41 614 704,74	0,32
TOTAL ESPAGNE			805 275 254,72	6,25
ETATS-UNIS				
DANAHER CORP 120124 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 992 156,57	0,04
FIDELITY NATIO 090124 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 963 063,53	0,24
HONEYWELL INTERNATIONAL INC 230124 FIX 0.0	EUR	18 000 000	17 949 933,40	0,14
NATIONAL GRID NORTH AMERICA 170124 FIX 0	EUR	25 000 000	24 946 206,14	0,19
TOTAL ETATS-UNIS			77 851 359,64	0,61
FRANCE				
ACCOR SA 220124 FIX 0.0	EUR	8 000 000	7 979 234,84	0,07
ALSTOM SA 310124 FIX 0.0	EUR	43 000 000	42 831 709,57	0,34
ARKEMA 060924 FIX 0.0	EUR	52 500 000	51 139 754,14	0,40
BEL SA 020224 FIX 0.0	EUR	8 000 000	7 970 208,91	0,06
BFCM (BANQUE FEDE 050724 OISEST 0.3	EUR	100 000 000	102 037 335,42	0,79
BFCM (BANQUE FEDER 191124 OISEST 0.33	EUR	60 000 000	60 281 055,60	0,47
BFCM (BANQUE FEDER 270824 OISEST 0.33	EUR	50 000 000	50 742 769,53	0,39
BFCM B OISEST+0.32% 04-07-24	EUR	150 000 000	152 642 989,62	1,18
BNP PARIBAS 070324 FIX 0.0	EUR	250 000 000	248 114 811,26	1,93
BNP PARIBAS 120424 OISEST 0.15	EUR	70 000 000	70 628 916,40	0,54
BONDUELLE 010324 FIX 0.0	EUR	34 000 000	33 751 606,74	0,26
BPCE 131224 OISEST 0.34	EUR	105 000 000	105 186 065,83	0,82
BPCE FACTOR SA 201224 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 830 168,69	0,04
BPCE FACTOR SA 310524 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 917 970,79	0,04
BPCE I OISEST+0.34% 20-12-24	EUR	100 000 000	100 092 643,47	0,78
BPCE SA 020424 OISEST 0.24	EUR	50 000 000	50 725 090,63	0,39
BPCE SA 030124 OISEST 0.35	EUR	100 000 000	103 617 420,00	0,81



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 28/12/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CA CON OISEST+0.25% 05-01-24	EUR	100 000 000	103 501 813,00	0,81
CA CONSUMER FINANCE 100524 OISEST 0.35	EUR	50 000 000	51 331 224,56	0,40
CDC HABITAT 100424 FIX 0.0	EUR	40 000 000	39 539 941,69	0,30
CFCM C OISEST+0.33% 05-07-24	EUR	100 000 000	102 071 418,75	0,79
CFCM - COMPAGNIE F 011124 OISEST 0.31	EUR	25 000 000	25 169 552,28	0,20
CFCM - COMPAGNIE F 021224 OISEST 0.31	EUR	20 000 000	20 033 507,78	0,16
CFCM - COMPAGNIE F 041024 OISEST 0.31	EUR	50 000 000	50 516 018,33	0,39
CFCM - COMPAGNIE F 201224 OISEST 0.31	EUR	20 000 000	20 016 032,00	0,15
CFCM - COMPAGNIE F 270224 OISEST 0.19	EUR	50 000 000	50 706 898,96	0,39
CICOBAIL 130524 OISEST 0.44	EUR	5 000 000	5 089 452,14	0,04
CIC OISEST+0.35% 02-04-24	EUR	105 000 000	108 142 746,95	0,84
CIC PARIS 030524 OISEST 0.21	EUR	100 000 000	101 011 825,56	0,79
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 040324 FIX 0	EUR	11 000 000	10 915 045,65	0,09
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 190324 FIX 0	EUR	9 000 000	8 914 637,44	0,07
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 280224 FIX 0	EUR	6 000 000	5 957 180,78	0,05
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 290224 FIX 0	EUR	3 000 000	2 978 238,39	0,02
COVIVIO HOTELS SCA 220324 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 952 120,91	0,04
COVIVIO HOTELS SCA 280324 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 949 123,02	0,04
CREDIT AGRICOLE SA 020124 OISEST 0.29	EUR	100 000 000	103 222 252,50	0,80
CREDIT AGRICOLE SA 070624 OISEST 0.36	EUR	100 000 000	102 391 907,78	0,79
CREDIT AGRICOLE SA 190424 OISEST 0.33	EUR	100 000 000	102 823 807,00	0,80
CREDIT AGRICOLE SA 271224 OISEST 0.31	EUR	100 000 000	100 000 594,44	0,77
CREDIT LYONNAIS 020124 OISEST 0.33	EUR	100 000 000	103 601 805,67	0,80
CREDIT LYONNAIS 280624 OISEST 0.36	EUR	100 000 000	102 202 527,78	0,79
CRED M OISEST+0.17% 07-06-24	EUR	25 000 000	25 060 886,85	0,19
CRED M OISEST+0.31% 11-12-24	EUR	25 000 000	25 051 510,63	0,20
CRED M OISEST+0.32% 08-08-24	EUR	100 000 000	101 702 638,06	0,79
DANONE SA 050424 FIX 0.0	EUR	5 500 000	5 441 390,69	0,05
DANONE SA 140224 FIX 0.0	EUR	9 000 000	8 953 834,92	0,07
DASSAULT SYSTEMES 040324 FIX 0.0	EUR	9 000 000	8 935 568,45	0,07
DIAC SA 090224 FIX 0.0	EUR	17 000 000	16 922 027,53	0,13
EDF 030424 FIX 0.0	EUR	100 000 000	98 935 532,82	0,77
EDF 210324 FIX 0.0	EUR	130 000 000	128 801 208,86	1,00
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 110124 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 927 581,29	0,38
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 170124 FIX 0.0	EUR	60 000 000	59 873 048,35	0,46
ENGIE SA 050124 OISEST 0.15	EUR	150 000 000	151 426 815,50	1,17
ENGIE SA 080124 OISEST 0.08	EUR	12 500 000	12 572 118,13	0,09
ENGIE SA 220124 OISEST 0.09	EUR	50 000 000	50 044 885,56	0,39
ENGIE SA 290224 FIX 0.0	EUR	13 000 000	12 911 300,09	0,10
GECINA 200324 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 910 413,93	0,07
KERING SA 110124 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 977 962,76	0,11
LA BANQUE POSTALE 120324 OISEST 0.2	EUR	200 000 000	203 855 373,00	1,58
NATIXIS 180924 OISEST 0.34	EUR	100 000 000	101 262 028,50	0,79
NATIXIS 230824 OISEST 0.34	EUR	100 000 000	101 539 918,00	0,78
NATIXIS BAIL 130524 OISEST 0.44	EUR	5 000 000	5 089 452,14	0,04
NATIXIS LEASE IMMO 310524 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 917 970,79	0,03
NATIXIS LEASE SA 201224 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 830 168,69	0,04
NEXITY 080124 FIX 0.0	EUR	16 000 000	15 978 340,92	0,12



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 28/12/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
RCI BANQUE ZCP 05-03-24	EUR	25 000 000	24 817 042,97	0,19
SCHNEIDER ELECTRIC SE 050224 FIX 0.0	EUR	16 000 000	15 932 380,15	0,12
SCHNEIDER ELECTRIC SE 080124 FIX 0.0	EUR	8 000 000	7 991 089,71	0,06
SEB SA 120124 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 984 274,38	0,08
SG OISEST+0.35% 31-10-24	EUR	100 000 000	100 709 907,47	0,78
SG OISEST+0.4% 31-10-24	EUR	100 000 000	100 759 501,92	0,78
SG OISEST+0.44% 31-12-24	EUR	50 000 000	50 614 185,13	0,40
SG OISEST+5.0% 23-06-25	EUR	18 000 000	18 030 218,80	0,14
SOCIETE FINANCIERE AGACHE 150424 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 822 301,36	0,12
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 140224 FIX 0.	EUR	13 000 000	12 931 091,69	0,10
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 150124 FIX 0.	EUR	12 500 000	12 476 004,14	0,10
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 170124 FIX 0.0	EUR	8 000 000	7 982 838,52	0,06
SOCIETE GENERALE SA 310524 OISEST 0.35	EUR	50 000 000	51 242 429,61	0,39
THALES SA 160124 FIX 0.0	EUR	24 000 000	23 951 669,12	0,19
VALEO SA 050324 FIX 0.0	EUR	17 000 000	16 873 332,27	0,13
VALEO SA 060324 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 969 750,63	0,04
VALEO SA 100624 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 926 906,35	0,03
VALEO SA 120624 FIX 0.0	EUR	27 000 000	26 500 628,34	0,21
VALEO SA 170624 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 904 747,96	0,04
VEOLIA ENVIRONNEMENT. 290424 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 672 209,95	0,19
VEOLIA ENVIRONNEMENT 140224 OISEST 0.15	EUR	47 000 000	47 722 119,37	0,37
VEOLIA ENVIRONNEMENT 150224 FIX 0.0	EUR	15 500 000	15 418 189,03	0,12
TOTAL FRANCE			4 342 684 220,13	33,69
IRLANDE				
DXC CAPITAL FUNDING DAC 010224 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 979 094,19	0,04
DXC CAPITAL FUNDING DAC 050124 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 994 824,82	0,05
DXC CAPITAL FUNDING DAC 060224 FIX 0.0	EUR	2 500 000	2 488 012,18	0,02
DXC CAPITAL FUNDING DAC 170124 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 985 965,94	0,05
DXC CAPITAL FUNDING DAC 260124 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 979 335,55	0,05
DXC CAPITAL FUNDING DAC 270224 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 955 773,42	0,05
DXC CAPITAL FUNDING DAC 280224 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 962 531,52	0,03
DXC CAPITAL FUNDING DAC 300124 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 976 387,16	0,05
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 041124	EUR	50 000 000	48 459 137,14	0,38
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 130924 FIX 0.0	EUR	50 000 000	48 679 795,30	0,37
TYCO INTERNATIONAL LTD 040124 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 993 199,63	0,07
TYCO INTERNATIONAL LTD 110324 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 587 473,82	0,38
TOTAL IRLANDE			199 041 530,67	1,54
ITALIE				
SNAM SPA 040324 FIX 0.0	EUR	83 000 000	82 382 075,39	0,64
SNAM SPA 100124 FIX 0.0	EUR	16 000 000	15 978 295,08	0,12
SNAM SPA 100124 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 979 651,64	0,11
SNAM SPA 190324 FIX 0.0	EUR	31 000 000	30 716 967,72	0,24
TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE 130224 FIX 0.0	EUR	73 500 000	73 124 244,97	0,57
UNICREDIT SPA 280224 FIX 0.0	EUR	100 000 000	99 337 986,82	0,77
TOTAL ITALIE			316 519 221,62	2,45



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 28/12/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
LUXEMBOURG				
ARCELOMITTAL 150224 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 973 452,37	0,04
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG 230224 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 691 542,51	0,39
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 130324 FIX 0.0	EUR	100 000 000	99 174 209,42	0,77
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 14052	EUR	50 000 000	49 255 507,65	0,38
TOTAL LUXEMBOURG			203 094 711,95	1,58
PAYS-BAS				
AKZO NOBEL NV 100524 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 639 595,54	0,19
AKZO NOBEL NV 170124 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 979 113,11	0,08
AKZO NOBEL NV 190224 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 965 737,25	0,05
ECOLAB INC 220224 FIX 0.0	EUR	35 000 000	34 781 880,41	0,27
EDP FINANCE BV 281223 FIX 0.0	UNKN OWN_ CURR ENCY	0,00	0,00	0,00
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 291223 FIX	EUR	15 000 000	15 000 000,00	0,12
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 291223 FIX	EUR	66 000 000	66 000 000,00	0,52
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 291223 FIX 0.0	EUR	70 000 000	70 000 000,00	0,54
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 310124 FIX	EUR	6 000 000	5 977 458,56	0,05
ENEL SPA 220124 FIX 0.0	EUR	29 000 000	28 920 728,28	0,22
FERROVIAL SE 040324 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 963 005,92	0,04
FERROVIAL SE 220224 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 845 803,49	0,20
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 060224 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 784 606,49	0,38
ING BANK N.V. 110924 FIX 0.0	EUR	50 000 000	48 703 570,61	0,37
TELEFONICA EUROPE BV 020224 FIX 0.0	EUR	27 000 000	26 892 549,70	0,21
TELEFONICA EUROPE BV 080124 FIX 0.0	EUR	21 000 000	20 976 086,68	0,16
TELEFONICA EUROPE BV 080524 FIX 0.0	EUR	11 000 000	10 838 279,18	0,09
TENNET HOLDING BV 220224 FIX 0.0	EUR	28 000 000	27 828 630,90	0,21
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 200224 FIX 0.0	EUR	35 000 000	34 788 980,39	0,27
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 200324 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 767 089,47	0,19
TOTAL PAYS-BAS			535 653 115,98	4,16
PORTUGAL				
REN-REDES ENERGETICAS NACIONAI 290124 FI	EUR	53 500 000	53 310 553,84	0,41
TOTAL PORTUGAL			53 310 553,84	0,41
ROYAUME-UNI				
BARCLAYS BANK PLC 250124 FIX 0.0	EUR	245 000 000	244 302 418,87	1,89
BARCLAYS BANK PLC 290824 OISEST 0.4	EUR	50 000 000	50 788 893,33	0,39
SSE PLC. 160124 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 959 400,58	0,16
SSE PLC. 190124 FIX 0.0	EUR	16 000 000	15 962 116,31	0,13
SSE PLC. 230224 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 842 330,15	0,19
TORONTO DOMINION BANK, THE 020824 FIX 0.0	EUR	50 000 000	48 893 765,65	0,38
TORONTO DOMINION BANK, THE 250324 FIX 0.	EUR	50 000 000	49 523 783,43	0,38
UBS AG LONDON 180624 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 087 079,58	0,38
UBS AG LONDON 260324 FIX 0.0	EUR	35 000 000	34 663 558,58	0,27
UBS AG LONDON 270624 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 041 194,78	0,38
UBS AG LONDON BRANCH 080824 FIX 0.0	EUR	50 000 000	48 846 131,58	0,38
TOTAL ROYAUME-UNI			635 910 672,84	4,93



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 28/12/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SUEDE				
VATTENFALL AB 070624 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 132 543,38	0,38
VATTENFALL AB 100624 FIX 0.0	EUR	29 000 000	28 487 984,50	0,23
VATTENFALL AB 110624 FIX 0.0	EUR	45 000 000	44 200 893,88	0,34
TOTAL SUEDE			121 821 421,76	0,95
TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			7 767 677 436,75	60,26
Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
FINLANDE				
NORDEA BANK ABP. 260824 FIX 0.0	EUR	50 000 000	48 789 582,10	0,38
TOTAL FINLANDE			48 789 582,10	0,38
IRLANDE				
DXC CAPITAL FUNDING DAC 020224 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 982 784,03	0,03
DXC CAPITAL FUNDING DAC 120224 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 972 341,97	0,04
DXC CAPITAL FUNDING DAC 180124 FIX 0.0	EUR	6 500 000	6 483 997,49	0,05
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 260924 FIX 0.0	EUR	50 000 000	48 624 509,86	0,38
TOTAL IRLANDE			64 063 633,35	0,50
LUXEMBOURG				
INTE BANK LUXE ZCP 13-08-24	EUR	50 000 000	48 815 406,30	0,38
TOTAL LUXEMBOURG			48 815 406,30	0,38
PAYS-BAS				
AMERICA MOVIL BV 160124 FIX 0.0	EUR	18 000 000	17 962 833,10	0,14
AMERICA MOVIL BV 160124 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 948 379,31	0,19
TOTAL PAYS-BAS			42 911 212,41	0,33
ROYAUME-UNI				
UBS AG LONDON BRANCH 061124 FIX 0.0	EUR	50 000 000	48 453 944,07	0,37
TOTAL ROYAUME-UNI			48 453 944,07	0,37
TOTAL Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé			253 033 778,23	1,96
TOTAL Titres de créances			8 020 711 214,98	62,22
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
OSTRUM SRI CASH A1P1 Part IC	EUR	1 742,9843	207 262 727,42	1,61
OSTRUM SRI CASH Part I	EUR	48 333,29711	536 904 630,95	4,17
OSTRUM SRI CASH PLUS I	EUR	5 136,6212	536 922 641,34	4,16
OSTRUM SRI MONEY 6M I	UNKN OWN_ CURR ENCY	0,00	0,00	0,00
TOTAL FRANCE			1 281 089 999,71	9,94
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			1 281 089 999,71	9,94
TOTAL Organismes de placement collectif			1 281 089 999,71	9,94
Titres reçus en pension				
ITALIE				
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.8% 15-06-29	EUR	26 530 000	24 712 695,00	0,19
TOTAL ITALIE			24 712 695,00	0,19
TOTAL Titres reçus en pension			24 712 695,00	0,19



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 28/12/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Indemnités sur titres reçus en pension			217 036,50	0,00
Instrument financier à terme				
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				
ESTR/0.0/FIX/3.9227	EUR	16 000 000	-554,98	0,00
ESTR/0.0/FIX/3.9232	EUR	7 000 000	-256,71	0,00
ESTR/0.0/FIX/3.928	EUR	7 500 000	-356,25	0,00
FIX/3.094/OISEST/0.0	EUR	37 300 000	-204 786,28	-0,01
FIX/3.9178/OISEST/0.	EUR	6 000 000	-51,08	0,00
FIX/3.922/OISEST/0.	EUR	6 000 000	-19,24	0,00
OISEST/0/FIX/2.994	EUR	11 500 000	59 557,55	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.603	EUR	28 000 000	211 127,71	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.619	EUR	37 300 000	382 864,77	0,00
OISEST/0.0/FIX/2.629	EUR	40 000 000	291 188,80	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.026	EUR	107 000 000	278 808,83	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.065	EUR	245 000 000	833 707,30	0,01
OISEST/0.0/FIX/3.073	EUR	60 000 000	172 099,75	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.094	EUR	50 000 000	115 668,12	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.186	EUR	35 000 000	167 480,95	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.209	EUR	75 000 000	311 859,71	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.28	EUR	50 000 000	190 902,49	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.294	EUR	10 000 000	-3 362,15	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.395	EUR	20 000 000	-13 163,61	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.428	EUR	44 000 000	-43 959,54	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.443	EUR	30 700 000	-397 674,29	-0,01
OISEST/0.0/FIX/3.444	EUR	50 000 000	-54 002,33	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.49	EUR	50 000 000	125 514,14	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.527	EUR	50 000 000	96 786,57	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.528	EUR	20 700 000	316 677,57	0,01
OISEST/0.0/FIX/3.529	EUR	57 000 000	108 869,73	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.530	EUR	10 000 000	153 384,33	0,01
OISEST/0.0/FIX/3.532	EUR	50 000 000	90 775,97	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.552	EUR	50 000 000	100 895,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.553	EUR	10 000 000	20 129,83	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.56	EUR	77 000 000	43 741,99	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.598	EUR	30 000 000	49 579,05	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.603	EUR	5 000 000	-21 287,99	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.611	EUR	12 500 000	18 479,50	0,01
OISEST/0.0/FIX/3.64	EUR	100 000 000	-19 584,28	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.666	EUR	10 000 000	-105 976,39	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.689	EUR	43 000 000	-126 508,73	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.689	EUR	50 000 000	-114 024,36	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.713	EUR	50 000 000	-125 841,03	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.719	EUR	50 000 000	-132 848,70	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.720	EUR	50 000 000	15 129,91	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.736	EUR	50 000 000	-23 512,29	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.737	EUR	20 000 000	-8 195,40	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.741	EUR	45 000 000	-30 563,15	0,00



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 28/12/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OISEST/0.0/FIX/3.747	EUR	52 500 000	-44 071,53	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.749	EUR	21 000 000	5 697,56	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.75	EUR	50 000 000	-18 411,62	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.751	EUR	50 000 000	5 283,33	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.758	EUR	29 000 000	1 711,70	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.770	EUR	50 000 000	1 632,64	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.770	EUR	45 000 000	-1 335,37	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.774	EUR	27 000 000	-1 853,91	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.774	EUR	4 000 000	-98,40	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.775	EUR	15 000 000	5 999,75	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.777	EUR	75 000 000	-90 064,81	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.778	EUR	50 000 000	-26 771,37	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.78	EUR	50 000 000	-38 681,67	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.785	EUR	100 000 000	61 372,92	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.785	EUR	5 000 000	-990,94	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.786	EUR	27 000 000	11 954,43	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.788	EUR	50 000 000	-10 667,77	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.789	EUR	30 000 000	19 118,61	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.796	EUR	35 000 000	19 008,91	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.798	EUR	17 000 000	7 333,75	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.798	EUR	50 000 000	5 963,66	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.804	EUR	15 500 000	6 867,36	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.804	EUR	1 250 000	393,47	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.809	EUR	100 000 000	-68 241,56	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.809	EUR	9 000 000	3 719,58	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.837	EUR	50 000 000	-30 335,62	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.850	EUR	50 000 000	12 712,17	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.862	EUR	50 000 000	-108 779,23	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.864	EUR	50 000 000	-108 277,50	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.877	EUR	80 000 000	-244 486,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.893	EUR	25 000 000	-5 678,13	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.897	EUR	11 000 000	-2 517,34	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.906	EUR	25 000 000	-5 864,23	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.911	EUR	50 000 000	-150 754,94	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.920	EUR	43 000 000	50,86	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.921	EUR	10 000 000	-21,92	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.921	EUR	8 000 000	-17,54	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.921	EUR	5 000 000	-7,07	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.921	EUR	25 000 000	-26,42	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.922	EUR	10 000 000	-56,63	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.922	EUR	26 000 000	-103,15	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.923	EUR	6 500 000	-55,64	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.923	EUR	12 500 000	-75,46	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.924	EUR	18 000 000	-126,71	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.924	EUR	14 000 000	-103,60	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.927	EUR	11 000 000	-228,17	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.928	EUR	6 000 000	-118,18	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.930	EUR	40 000 000	-1 031,33	0,00

**• PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 28/12/2023 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OISEST/0.0/FIX/3.931	EUR	15 000 000	-2 627,22	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.931	EUR	6 000 000	-178,51	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.931	EUR	6 000 000	-135,36	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.931	EUR	30 000 000	-849,33	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.933	EUR	6 000 000	-211,51	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.933	EUR	14 000 000	-505,78	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.944	EUR	50 000 000	-3 159,83	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.947	EUR	50 000 000	-4 695,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.947	EUR	43 000 000	-3 128,49	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.948	EUR	40 000 000	-8 926,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.955	EUR	5 500 000	-1 233,35	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.956	EUR	100 000 000	-21 567,67	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.957	EUR	5 000 000	-1 282,65	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.974	EUR	30 000 000	-7 278,15	0,00
TOTAL Swaps de taux			1 881 888,88	0,02
TOTAL Autres instruments financiers à terme			1 881 888,88	0,02
TOTAL Instrument financier à terme			1 881 888,88	0,02
Créances			3 884 641,40	0,03
Dettes			-6 102 342,92	-0,05
Comptes financiers			445 031 129,50	3,45
Actif net			12 891 298 743,41	100,00



● 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

12 place des États-Unis
CS 40083
92549 - Montrouge Cedex

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, CACEIS 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)

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

Parts	R	IC	N**	M	ID
Isin	FR0010885210	FR0010885236	FR0013230257	FR0013527785	FR0010885251
Charges d'exploitation	366 858,77	8 878 455,81	157 891,58	726 397,77	44 299,68
Fortune moyenne du fonds	412 940 188,04	11 991 323 766,82	219 702 927,93	1 001 287 777,70	65 687 045,41
TER	0,08%	0,07%	0,07%	0,07%	0,06%
Commission de surperformance	58 962,80	1 665 913,94	0,02	0,00	6 677,11
Fortune moyenne du fonds	412 940 188,04	11 991 323 766,82	219 702 927,93	1 001 287 777,70	65 687 045,41
TER de surperformance	0,01%	0,01%	0,00%	0,00%	0,01%
Frais de fonctionnement et de gestion	0,07%	0,06%	0,07%	0,07%	0,05%

Changement taux de frais de gestion sur la période :

	Ancien taux	Taux à compter du 02/05/2022	Taux à compter du 09/11/2022
R	0,08		0,13
IC	0,05	0,07	
ID	0,05	0,07	

* Le TER présenté a été calculé conformément à la réglementation suisse cf "Directive pour le calcul et la publication du Total Expense Ratio (TER) des placements collectifs de capitaux" établie par l'Asset Management Association Switzerland AMAS,

** 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 28/12/2023

Libellé **Code Isin** **Devise**
 OSTRUM SRI MONEY PLUS R(C) FR0010885210 EUR

	Fonds	Indice de référence	Ecart
2018 au 2023	0,44	0,37	-0,07
2020 au 2023	0,96	0,91	-0,06
2022 au 2023	3,40	3,31	-0,09

Libellé **Code Isin** **Devise**
 OSTRUM SRI MONEY PLUS I(C) FR0010885236 EUR

	Fonds	Indice de référence	Ecart
2018 au 2023	0,46	0,37	-0,09
2020 au 2023	0,99	0,91	-0,08
2022 au 2023	3,44	3,31	-0,13

Libellé **Code Isin** **Devise**
 OSTRUM SRI MONEY PLUS I(D) FR0010885251 EUR

	Fonds	Indice de référence	Ecart
2018 au 2023	0,45	0,37	-0,08
2020 au 2023	0,99	0,91	-0,08
2022 au 2023	3,44	3,31	-0,13

Libellé **Code Isin** **Devise**
 OSTRUM SRI MONEY PLUS M(C) FR0013527785 EUR

	Fonds	Indice de référence	Ecart
2020 au 2023	0,99	0,91	-0,08
2022 au 2023	3,47	3,31	-0,16

Libellé **Code Isin** **Devise**
 OSTRUM SRI MONEY PLUS N(C) FR0013230257 EUR

	Fonds	Indice de référence	Ecart
2022 au 2023	3,45	3,31	-0,15

Indice de référence

100% ESTR CAPITALISE

Libellé	Code Isin	Devise	Commentaire
OSTRUM SRI MONEY PLUS R(C)	FR0010885210	EUR	
OSTRUM SRI MONEY PLUS I(C)	FR0010885236	EUR	
OSTRUM SRI MONEY PLUS I(D)	FR0010885251	EUR	
OSTRUM SRI MONEY PLUS M(C)	FR0013527785	EUR	
OSTRUM SRI MONEY PLUS N(C)	FR0013230257	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 28/12/2023 EN EUR

	28/12/2023	30/06/2023
IMMOBILISATIONS NETTES	0,00	0,00
DÉPÔTS	0,00	0,00
INSTRUMENTS FINANCIERS	12 450 927 476,82	13 990 755 225,80
Actions et valeurs assimilées	0,00	0,00
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Obligations et valeurs assimilées	3 119 872 480,36	3 014 700 421,78
Négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	3 119 872 480,36	3 014 700 421,78
Non négoiciées sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Titres de créances	8 020 711 214,98	9 570 438 177,91
Négoiés sur un marché réglementé ou assimilé	7 767 677 436,75	9 570 438 177,91
Titres de créances négociables	7 746 744 951,69	9 570 438 177,91
Autres titres de créances	20 932 485,06	0,00
Non négoiés sur un marché réglementé ou assimilé	253 033 778,23	0,00
Organismes de placement collectif	1 281 089 999,71	1 394 368 633,80
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	1 281 089 999,71	1 394 368 633,80
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
Opérations temporaires sur titres	24 929 731,50	0,00
Créances représentatives de titres reçus en pension	24 929 731,50	0,00
Créances représentatives de titres prêtés	0,00	0,00
Titres empruntés	0,00	0,00
Titres donnés en pension	0,00	0,00
Autres opérations temporaires	0,00	0,00
Instruments financiers à terme	4 324 050,27	11 247 992,31
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Autres opérations	4 324 050,27	11 247 992,31
Autres instruments financiers	0,00	0,00
CRÉANCES	3 884 641,40	1 539 078,38
Opérations de change à terme de devises	0,00	0,00
Autres	3 884 641,40	1 539 078,38
COMPTES FINANCIERS	445 031 129,88	163 208 797,44
Liquidités	445 031 129,88	163 208 797,44
TOTAL DE L'ACTIF	12 899 843 248,10	14 155 503 101,62

**BILAN PASSIF AU 28/12/2023 EN EUR**

	28/12/2023	30/06/2023
CAPITAUX PROPRES		
Capital	12 662 560 080,17	13 932 794 186,77
Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées (?)	0,00	0,00
Report à nouveau (?)	0,57	0,00
Plus et moins-values nettes de l'exercice (?,??)	18 791 452,82	-17 545 478,94
Résultat de l'exercice (?,??)	209 947 209,85	226 867 810,88
TOTAL DES CAPITAUX PROPRES *	12 891 298 743,41	14 142 116 518,71
<i>* Montant représentatif de l'actif net</i>		
INSTRUMENTS FINANCIERS	2 442 161,39	336 182,01
Opérations de cession sur instruments financiers	0,00	0,00
Opérations temporaires sur titres	0,00	0,00
Dettes représentatives de titres donnés en pension	0,00	0,00
Dettes représentatives de titres empruntés	0,00	0,00
Autres opérations temporaires	0,00	0,00
Instruments financiers à terme	2 442 161,39	336 182,01
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Autres opérations	2 442 161,39	336 182,01
DETTES	6 102 342,92	13 050 400,53
Opérations de change à terme de devises	0,00	0,00
Autres	6 102 342,92	13 050 400,53
COMPTES FINANCIERS	0,38	0,37
Concours bancaires courants	0,38	0,37
Emprunts	0,00	0,00
TOTAL DU PASSIF	12 899 843 248,10	14 155 503 101,62



COMPTE DE RÉSULTAT AU 28/12/2023 EN EUR

	28/12/2023	30/06/2023
Produits sur opérations financières		
Produits sur dépôts et sur comptes financiers	10 716 556,91	13 035 402,44
Produits sur actions et valeurs assimilées	0,00	0,00
Produits sur obligations et valeurs assimilées	48 247 389,87	55 669 125,91
Produits sur titres de créances	173 030 810,82	167 594 903,99
Produits sur acquisitions et cessions temporaires de titres	895 933,02	74 724,08
Produits sur instruments financiers à terme	8 413 379,98	18 054 384,41
Autres produits financiers	0,00	0,00
TOTAL (1)	241 304 070,60	254 428 540,83
Charges sur opérations financières		
Charges sur acquisitions et cessions temporaires de titres	130 491,30	193 532,40
Charges sur instruments financiers à terme	432 722,94	2 983 412,23
Charges sur dettes financières	-10 185,49	186 808,05
Autres charges financières	0,00	0,00
TOTAL (2)	553 028,75	3 363 752,68
RÉSULTAT SUR OPÉRATIONS FINANCIÈRES (1 - 2)	240 751 041,85	251 064 788,15
Autres produits (3)	0,00	0,00
Frais de gestion et dotations aux amortissements (4)	10 643 714,05	16 170 794,51
RÉSULTAT NET DE L'EXERCICE (L. 214-17-1) (1 - 2 + 3 - 4)	230 107 327,80	234 893 993,64
Régularisation des revenus de l'exercice (5)	-20 160 117,95	-8 026 182,76
Acomptes sur résultat versés au titre de l'exercice (6)	0,00	0,00
RÉSULTAT (1 - 2 + 3 - 4 + 5 - 6)	209 947 209,85	226 867 810,88

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

	En parts	En montant
OSTRUM SRI MONEY PLUS I(C)		
Parts souscrites durant l'exercice	206 769,1980	21 703 048 694,39
Parts rachetées durant l'exercice	-221 211,1670	-23 223 920 994,93
Solde net des souscriptions/rachats	-14 441,9690	-1 520 872 300,54
Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	103 899,0315	
OSTRUM SRI MONEY PLUS I(D)		
Parts souscrites durant l'exercice	9,2544	920 002,21
Parts rachetées durant l'exercice	-101,1766	-10 000 171,57
Solde net des souscriptions/rachats	-91,9222	-9 080 169,36
Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	277,6127	
OSTRUM SRI MONEY PLUS M(C)		
Parts souscrites durant l'exercice	764,2000	77 639 851,48
Parts rachetées durant l'exercice	-2 567,6500	-261 033 776,10
Solde net des souscriptions/rachats	-1 803,4500	-183 393 924,62
Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	8 994,5000	
OSTRUM SRI MONEY PLUS N(C)		
Parts souscrites durant l'exercice	12 576,0102	128 261 408,18
Parts rachetées durant l'exercice	-30 472,7255	-311 713 050,56
Solde net des souscriptions/rachats	-17 896,7153	-183 451 642,38
Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	17 333,8538	
OSTRUM SRI MONEY PLUS R(C)		
Parts souscrites durant l'exercice	77 164,0942	804 505 600,72
Parts rachetées durant l'exercice	-41 051,8660	-429 464 563,82
Solde net des souscriptions/rachats	36 112,2282	375 041 036,90
Nombre de parts en circulation à la fin de l'exercice	71 953,5943	



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