



NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

OPCVM de droit français

OSTRUM SRI CREDIT ULTRA SHORT PLUS

RAPPORT SEMESTRIEL

au 30 juin 2022

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	969 806 295,26
b) Avoirs bancaires	72 227,37
c) Autres actifs détenus par l'OPC	156 657 818,65
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	1 126 536 341,28
e) Passif	-77 456 934,11
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	1 049 079 407,17

* 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 CREDIT ULTRA SHORT PLUS AC en EUR	C	452 704 155,33	45 206,2745	10 014,18
OSTRUM SRI CREDIT ULTRA SHORT PLUS IC en EUR	C	64 438 439,49	64 443,6497	999,91
OSTRUM SRI CREDIT ULTRA SHORT PLUS N1 en EUR	C	15 902 013,61	16 074,4730	989,27
OSTRUM SRI CREDIT ULTRA SHORT PLUS SI en EUR	C	516 034 798,74	335 460,0994	1 538,28



● 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.	75,04	69,88
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.	17,40	16,21
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.	2,04	1,90

* 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	950 626 641,41	90,62	84,38
Dollar Us	USD	9 742 698,52	0,93	0,86
Livre Sterling	GBP	9 436 955,33	0,90	0,84
TOTAL		969 806 295,26	92,44	86,09

* 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	40,68	37,89
ITALIE	17,51	16,30
ETATS-UNIS	8,36	7,79
LUXEMBOURG	6,96	6,48
ROYAUME-UNI	6,96	6,48
ALLEMAGNE	2,84	2,64
PAYS-BAS	2,53	2,35
PORTUGAL	2,26	2,11
REPUBLIQUE DE COREE	2,08	1,93
IRLANDE	0,98	0,91
ESPAGNE	0,70	0,65
HONGRIE	0,40	0,37
SUEDE	0,19	0,18
TOTAL	92,44	86,09

* 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	2,04	1,90
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	2,04	1,90

* 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.	339 175 639,18	238 661 878,24
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.	120 393 128,15	63 852 153,96
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.	290 873 327,81	363 511 974,72

• 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**

	30/06/2022
Parts OSTRUM SRI CREDIT ULTRA SHORT PLUS AC	
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 CREDIT ULTRA SHORT PLUS IC	
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 CREDIT ULTRA SHORT PLUS N1	
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 CREDIT ULTRA SHORT PLUS SI	
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



• 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	60 995 603,11	0,00	0,00
% de l'Actif Net	0,00%	0,00%	5,81%	0,00%	0,00%

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			60 995 603,11		
---	--	--	---------------	--	--

e) Type et qualité des garanties (collatéral)

Type					
- Actions	0,00			0,00	0,00
- Obligations	0,00			0,00	0,00
- OPC	0,00			0,00	0,00
- TCN	0,00			0,00	0,00
- Cash	0,00		64 987 485,66		0,00
Rating					

Monnaie de la garantie					
Euro	0,00		64 987 485,66	0,00	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			0,00	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
1 jour à 1 semaine	0,00		0,00	0,00	0,00
1 semaine à 1 mois	0,00		0,00	0,00	0,00
1 à 3 mois	0,00		0,00	0,00	0,00
3 mois à 1 an	0,00		0,00	0,00	0,00
Plus d'1 an	0,00		0,00	0,00	0,00
Ouvertes	0,00		60 995 603,11	0,00	0,00

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

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

Titres					
Cash					



	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	251 207,92	0,00	
- 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 30/06/2022 EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Dépôts				
Collat. especes p/e	EUR	64 195 720,96	64 157 670,84	6,12
TOTAL Dépôts			64 157 670,84	6,12
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 1.625% 16-11-23	EUR	2 100 000	2 042 232,45	0,19
INFINEON TECHNOLOGIES AG 0.75% 24-06-23	EUR	500 000	497 321,64	0,05
THYSSENKRUPP AG 1.875% 06-03-23	EUR	3 500 000	3 442 176,16	0,33
ZF NA CAPITAL 2.75% 27-04-23	EUR	24 000 000	23 800 606,03	2,27
TOTAL ALLEMAGNE			29 782 336,28	2,84
ESPAGNE				
CAIXABANK 1.75% 24-10-23 EMTN	EUR	2 800 000	2 820 099,40	0,27
CELL 3.125% 27-07-22 EMTN	EUR	4 400 000	4 534 060,77	0,43
TOTAL ESPAGNE			7 354 160,17	0,70
ETATS-UNIS				
AT T 2.75% 19-05-23	EUR	25 000 000	25 495 859,59	2,43
BALL 0.875% 15-03-24	EUR	3 000 000	2 845 442,49	0,27
BALL 4.375% 15-12-23	EUR	11 306 000	11 736 127,09	1,12
BECTON DICKINSON AND 0.0% 13-08-23	EUR	6 500 000	6 390 280,00	0,61
CELA US HOLD 1.125% 26-09-23	EUR	4 151 000	4 086 521,89	0,39
FORD MOTOR CREDIT 1.514% 17-02-23	EUR	7 000 000	6 946 707,37	0,66
FORD MOTOR CREDIT E3R+0.42% 07-12-22	EUR	5 000 000	4 964 043,89	0,47
GOLD SAC 2.0% 27-07-23 EMTN	EUR	13 172 000	13 475 885,26	1,28
PROLOGIS EURO FINANCE LLC E3R+0.2% 08-02-24	EUR	11 800 000	11 796 460,00	1,13
TOTAL ETATS-UNIS			87 737 327,58	8,36
FRANCE				
ACCOR 2.5% 25-01-24	EUR	25 200 000	24 692 344,27	2,36
ALD 0.0% 23-02-24 EMTN	EUR	6 000 000	5 786 940,00	0,55
ALD 0.375% 18-07-23 EMTN	EUR	10 000 000	9 910 450,68	0,95
BEL E3R+0.65% 27-09-23 EMTN	EUR	5 000 000	5 002 093,33	0,48
BPCE 0.875% 31-01-24 EMTN	EUR	10 000 000	9 865 258,90	0,94
BPCE 4.625% 18/07/23	EUR	4 000 000	4 267 636,71	0,41
BURE VERI 1.25% 07-09-23	EUR	7 900 000	7 930 865,19	0,76
CNP ASSURANCES 1.875% 20-10-22	EUR	5 600 000	5 686 164,82	0,54
CROWN EU HLD 0.75% 15-02-23	EUR	8 300 000	8 153 691,75	0,77
CROWN EU HLD 2.25% 01-02-23	EUR	1 300 000	1 300 562,25	0,12
DASSAULT SYSTMES 0.0% 16-09-22	EUR	12 700 000	12 689 459,00	1,21
ELIS EX HOLDELIS 1.875% 15-02-23	EUR	22 500 000	22 536 560,96	2,14
FRFP 3 1/4 01/22/24	EUR	12 500 000	12 645 844,18	1,20
FROMAGERIES BEL LA VACHE QUI RIT 1.5% 18-04-24	EUR	9 200 000	9 150 964,00	0,87
ILIAD 0.75% 11-02-24	EUR	5 000 000	4 698 080,82	0,44
ILIAD 2.125% 05-12-22	EUR	17 100 000	17 260 250,42	1,65
IPNFP 1 7/8 06/16/23	EUR	6 100 000	6 076 387,99	0,58
JCDECAUX 1.0% 01-06-23	EUR	2 300 000	2 291 822,40	0,21
LAGARDERE 2.75% 13-04-23	EUR	14 900 000	14 974 451,01	1,42
L OREAL S A E3R+0.7% 29-03-24	EUR	11 600 000	11 724 971,31	1,11



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
NEXANS 3.75% 08-08-23	EUR	35 500 000	36 845 561,85	3,51
ORANO SA 3.125% 20-03-23 EMTN	EUR	25 500 000	25 741 048,36	2,45
RENAULT 1.0% 08-03-23 EMTN	EUR	8 031 000	7 983 402,57	0,76
RENAULT CREDIT INTL BANQUE 0.25% 08-03-23	EUR	7 273 000	7 225 731,48	0,69
RENAULT CREDIT INTL BANQUE 1.375% 08-03-24	EUR	2 600 000	2 551 885,75	0,25
RENAULT CREDIT INTL BANQUE E3R+0.43% 12-01-23	EUR	8 565 000	8 545 900,05	0,82
SEB 2.375% 25-11-22	EUR	5 900 000	5 989 502,19	0,57
SOCGEN 4 06/07/23	EUR	12 800 000	13 018 247,01	1,24
SODEXO 0.5% 17-01-24	EUR	5 200 000	5 097 490,19	0,49
SPIE 3.125% 22-03-24	EUR	10 400 000	10 416 761,10	1,00
TDF INFR SAS 2.875% 19-10-22	EUR	10 000 000	10 212 868,49	0,98
UBISOFT 1.289% 30-01-23	EUR	18 400 000	18 515 231,39	1,76
VALEO 0.375% 12-09-22 EMTN	EUR	22 800 000	22 824 845,75	2,18
VALEO ELECTRONIQUE ET SYSTEMES DE L 0.625% 11-01-23	EUR	3 900 000	3 886 548,74	0,38
TOTAL FRANCE			375 499 824,91	35,79
HONGRIE				
MAGY OLAJ GAZ 2.625% 28-04-23	EUR	4 150 000	4 160 876,41	0,40
TOTAL HONGRIE			4 160 876,41	0,40
IRLANDE				
BANK IRELAND 10% 19/12/2022	EUR	9 400 000	10 251 515,10	0,97
TOTAL IRLANDE			10 251 515,10	0,97
ITALIE				
AUTO PER L IT 1.625% 12-06-23	EUR	20 184 000	20 117 016,77	1,92
BACRED 5 3/4 04/18/23	EUR	20 240 000	21 019 644,80	2,01
BANCO BPM E3R+4.375% 30-07-22	EUR	14 776 000	14 879 693,83	1,42
ENIIM 1 3/4 01/18/24	EUR	2 000 000	2 019 290,14	0,19
FERRARI NV 1.5% 16-03-23	EUR	9 400 000	9 458 901,95	0,90
FERROVIE DELLO STATO ITALIANE 0.875% 07-12-23	EUR	15 826 000	15 762 923,63	1,51
INTESA SANPAOLO SPA 6.625% 13/09/2023	EUR	30 100 000	32 824 862,29	3,12
IREN 2.75% 02-11-22 EMTN	EUR	6 580 000	6 757 345,42	0,64
PIRELLI C 1.375% 25-01-23 EMTN	EUR	28 575 000	28 784 360,80	2,75
TELE ITA 3.25% 16-01-23 EMTN	EUR	13 600 000	13 827 688,22	1,32
UNICREDIT SPA 6.95% 31/10/2022	EUR	17 120 000	18 196 496,22	1,73
TOTAL ITALIE			183 648 224,07	17,51
LUXEMBOURG				
ARCELLOR MITTAL 1.0% 19-05-23	EUR	17 000 000	16 850 411,64	1,60
CNH INDU 2.875% 17-05-23 EMTN	EUR	9 000 000	9 154 581,78	0,88
MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.375% 07-03-23	EUR	15 800 000	15 787 699,81	1,51
SBB TREASURY OYJ E3R+0.55% 08-02-24	EUR	8 000 000	6 438 639,33	0,61
SIG COMBIBLOC PURCHASER 1.875% 18-06-23	EUR	11 450 000	11 306 989,50	1,08
STELLANTIS 4.75% 150722	EUR	12 824 000	13 425 547,49	1,28
TOTAL LUXEMBOURG			72 963 869,55	6,96
PAYS-BAS				
CTP BV	EUR	10 277 000	9 646 110,46	0,92
ED 2.375% 23-03-23 EMTN	EUR	13 000 000	13 194 503,15	1,25
ENEL INVES 5.25% 29/09/23 *EUR	EUR	1 387 000	1 506 865,87	0,15
NATURGY FINANCE BV 3.875% 17-01-23	EUR	2 100 000	2 176 085,01	0,21
TOTAL PAYS-BAS			26 523 564,49	2,53



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
PORTUGAL				
GALP ENERGIA 1.0% 15-02-23	EUR	23 700 000	23 758 980,53	2,27
TOTAL PORTUGAL			23 758 980,53	2,27
REPUBLIQUE DE COREE				
LG CHEM 0.5% 15-04-23	EUR	21 915 000	21 794 053,22	2,07
TOTAL REPUBLIQUE DE COREE			21 794 053,22	2,07
ROYAUME-UNI				
BABC INT 1.75% 06-10-22 EMTN	EUR	13 000 000	13 169 537,81	1,25
BARCLAYS BANK PLC 7.625% 21/11/2022	USD	10 000 000	9 742 698,52	0,92
BRITISH TEL 0.875% 26-09-23	EUR	5 400 000	5 389 472,22	0,52
BUPA 5% 04/23	GBP	8 000 000	9 436 955,33	0,90
DIAGEO FINANCE 0.125% 12-10-23	EUR	1 700 000	1 675 373,52	0,16
GSK 0 09/23/23	EUR	15 657 000	15 429 190,65	1,47
OTE 2.375% 18-07-22 EMTN	EUR	17 780 000	18 206 520,28	1,74
TOTAL ROYAUME-UNI			73 049 748,33	6,96
SUEDE				
DOMETIC GROUP AB 3.0% 13-09-23	EUR	2 000 000	1 989 371,23	0,19
TOTAL SUEDE			1 989 371,23	0,19
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			918 513 851,87	87,55
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			918 513 851,87	87,55
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
FRANCE				
FAURECIA 281022 FIX 0.0	EUR	12 000 000	11 984 704,22	1,14
KORI E3R+0.95% 05-11-23	EUR	15 000 000	14 552 868,75	1,39
NEXITY E3R+0.91% 14-01-24	EUR	10 000 000	9 873 735,00	0,94
NEXITY E3R+1.3% 06-09-23	EUR	15 000 000	14 881 135,42	1,42
TOTAL FRANCE			51 292 443,39	4,89
TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			51 292 443,39	4,89
TOTAL Titres de créances			51 292 443,39	4,89
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	1,7013	195 390,06	0,01
OSTRUM SRI CASH PLUS I	EUR	92,5817	9 338 289,28	0,89
OSTRUM SRI MONEY 6M I	EUR	96,78274	999 039,83	0,10
OSTRUM SRI MONEY I C	EUR	24,17772	297 616,85	0,03
OSTRUM SRI MONEY PLUS IC	EUR	9,7917	999 132,73	0,10
TOTAL FRANCE			11 829 468,75	1,13
LUXEMBOURG				
NATIXIS SH.TERM GL HI INC H-IA	EUR	89 180	9 573 473,00	0,91
TOTAL LUXEMBOURG			9 573 473,00	0,91
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			21 402 941,75	2,04
TOTAL Organismes de placement collectif			21 402 941,75	2,04



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Titres donnés en pension				
ALLEMAGNE				
DEUTSCHE LUFTHANSA AG 1.625% 16-11-23	EUR	2 700 000	2 625 727,43	0,25
INFINEON TECHNOLOGIES AG 0.75% 24-06-23	EUR	1 500 000	1 491 964,93	0,14
THYSSENKRUPP AG 1.875% 06-03-23	EUR	8 500 000	8 359 570,68	0,80
TOTAL ALLEMAGNE			12 477 263,04	1,19
FRANCE				
BURE VERI 1.25% 07-09-23	EUR	2 100 000	2 108 204,67	0,20
CNP ASSURANCES 1.875% 20-10-22	EUR	4 700 000	4 772 316,90	0,45
CROWN EU HLD 0.75% 15-02-23	EUR	1 700 000	1 670 033,25	0,16
DASSAULT SYSTES 0.0% 16-09-22	EUR	500 000	499 585,00	0,05
ELIS EX HOLDELIS 1.875% 15-02-23	EUR	2 800 000	2 804 549,81	0,27
ILIAD 2.125% 05-12-22	EUR	100 000	100 937,14	0,01
JCDECAUX 1.0% 01-06-23	EUR	3 800 000	3 786 489,17	0,36
L OREAL S A E3R+0.7% 29-03-24	EUR	1 700 000	1 718 314,76	0,16
NEXANS 3.75% 08-08-23	EUR	1 800 000	1 868 225,68	0,18
TOTAL FRANCE			19 328 656,38	1,84
ITALIE				
BACRED 5 3/4 04/18/23	EUR	2 100 000	2 180 892,00	0,20
FERRARI NV 1.5% 16-03-23	EUR	1 000 000	1 006 266,16	0,10
PIRELLI C 1.375% 25-01-23 EMTN	EUR	3 073 000	3 095 514,99	0,29
TOTAL ITALIE			6 282 673,15	0,59
ROYAUME-UNI				
BRITISH TEL 0.875% 26-09-23	EUR	1 300 000	1 297 465,53	0,13
TOTAL ROYAUME-UNI			1 297 465,53	0,13
SUEDE				
DOMETIC GROUP AB 3.0% 13-09-23	EUR	21 725 000	21 609 545,01	2,06
TOTAL SUEDE			21 609 545,01	2,06
TOTAL Titres donnés en pension			60 995 603,11	5,81
Dettes représentatives des titres données en pension			-65 008 674,00	-6,19
Indemnités sur titres données en pension			21 188,34	0,00
Instrument financier à terme				
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				
FIX/0.411/OISEST/0.0	EUR	30 000 000	-189 868,33	-0,01
FIX/1.227/OISEST/0.0	EUR	10 000 000	36 804,80	0,01
OIEST/0.0/FIX/-0.54	EUR	15 000 000	248 852,33	0,03
OISEST/0.0/FIX/0.002	EUR	15 000 000	207 044,04	0,02
OISEST/0.0/FIX/-0.01	EUR	10 000 000	55 912,95	0,00
OISEST/0.0/FIX/-0.03	EUR	10 000 000	66 310,55	0,00
OISEST/0.0/FIX/-0.04	EUR	10 000 000	154 833,20	0,01
OISEST/0.0/FIX/-0.04	EUR	20 000 000	311 081,60	0,03
OISEST/0.0/FIX/0.085	EUR	15 000 000	216 677,17	0,02
OISEST/0.0/FIX/-0.14	EUR	40 000 000	143 662,44	0,02
OISEST/0.0/FIX/-0.14	EUR	15 000 000	273 015,18	0,02
OISEST/0.0/FIX/-0.16	EUR	15 000 000	129 322,31	0,01
OISEST/0.0/FIX/-0.21	EUR	15 000 000	143 652,31	0,02



● **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OISEST/0.0/FIX/-0.26	EUR	15 000 000	172 975,93	0,01
OISEST/0.0/FIX/0.31	EUR	10 000 000	73 435,12	0,00
OISEST/0.0/FIX/-0.31	EUR	20 000 000	153 930,85	0,01
OISEST/0.0/FIX/-0.33	EUR	15 000 000	288 955,65	0,03
OISEST/0.0/FIX/-0.35	EUR	20 000 000	398 419,96	0,03
OISEST/0.0/FIX/0.379	EUR	10 000 000	93 910,14	0,01
OISEST/0.0/FIX/-0.43	EUR	25 000 000	187 855,42	0,02
OISEST/0.0/FIX/-0.45	EUR	17 000 000	83 731,07	0,01
OISEST/0.0/FIX/-0.45	EUR	10 000 000	166 995,35	0,01
OISEST/0.0/FIX/-0.46	EUR	20 000 000	388 859,74	0,04
OISEST/0.0/FIX/-0.48	EUR	15 000 000	286 734,23	0,03
OISEST/0.0/FIX/-0.53	EUR	15 000 000	255 364,01	0,02
OISEST/0.0/FIX/-0.54	EUR	10 000 000	98 084,95	0,01
OISEST/0.0/FIX/-0.54	EUR	10 000 000	113 330,00	0,01
OISEST/0.0/FIX/-0.54	EUR	10 000 000	160 716,88	0,02
OISEST/0.0/FIX/-0.54	EUR	15 000 000	240 624,62	0,03
OISEST/0.0/FIX/-0.54	EUR	15 000 000	243 149,84	0,02
OISEST/0.0/FIX/-0.54	EUR	10 000 000	162 903,30	0,01
OISEST/0.0/FIX/-0.55	EUR	20 000 000	313 779,68	0,03
OISEST/0.0/FIX/-0.55	EUR	15 000 000	238 834,63	0,02
OISEST/0.0/FIX/-0.55	EUR	10 000 000	109 606,70	0,01
OISEST/0.0/FIX/-0.55	EUR	20 000 000	263 887,15	0,02
OISEST/0.0/FIX/-0.55	EUR	10 000 000	110 481,93	0,01
OISEST/0.0/FIX/-0.56	EUR	15 000 000	239 216,89	0,02
OISEST/0.0/FIX/-0.56	EUR	15 000 000	238 169,40	0,02
OISEST/0.0/FIX/-0.57	EUR	15 000 000	118 392,93	0,01
OISEST/0.0/FIX/-0.57	EUR	15 000 000	124 281,40	0,01
OISEST/0.0/FIX/-0.58	EUR	15 000 000	121 202,56	0,02
OISEST/0.0/FIX/-0.58	EUR	15 000 000	121 420,42	0,02
OISEST/0.0/FIX/-0.60	EUR	15 000 000	36 718,44	0,01
OISEST/0.0/FIX/-0.61	EUR	10 000 000	4 935,50	0,00
OISEST/0.0/FIX/-0.62	EUR	15 000 000	48 607,62	0,01
OISEST/0.0/FIX/-0.64	EUR	20 000 000	43 056,20	0,00
OISEST/0.0/FIX/0.647	EUR	10 000 000	61 407,39	0,01
OISEST/0.0/FIX/0.66	EUR	10 000 000	60 887,91	0,01
OISEST/0.0/FIX/0.895	EUR	15 000 000	-1 847,90	0,00
TOTAL Swaps de taux			7 620 316,46	0,73
Swaps de devises				
E3R/0.693/FIX/5.0	EUR	9 275 362,32	9 214 918,08	0,88
E3R/0.693/FIX/5.0	GBP	0	-9 436 955,33	-0,90
TOTAL Swaps de devises			-222 037,25	-0,02
Asset swaps				
E3R/0.0/FIX/7.625	EUR	8 400 008,4	8 380 821,94	0,80
E3R/0.0/FIX/7.625	USD	0	-9 742 698,52	-0,94
TOTAL Asset swaps			-1 361 876,58	-0,14
TOTAL Autres instruments financiers à terme			6 036 402,63	0,57
TOTAL Instrument financier à terme			6 036 402,63	0,57



- **PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/06/2022 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Créances			2 289 570,26	0,22
Dettes			-10 680 965,66	-1,02
Comptes financiers			59 374,64	0,01
Actif net			1 049 079 407,17	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