



NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

OPCVM de droit français

OSTRUM SOUVERAINS EURO 1-3

RAPPORT SEMESTRIEL

au 30 septembre 2021

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	37 709 880,66
b) Avoirs bancaires	102 789,97
c) Autres actifs détenus par l'OPC	44 360,11
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	37 857 030,74
e) Passif	-11 878,83
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	37 845 151,91

* 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 SOUVERAINS EURO 1-3 I en EUR	C	24 582 461,29	7 616,0214	3 227,73
OSTRUM SOUVERAINS EURO 1-3 MC en EUR	C	1 511 368,40	661,0000	2 286,48
OSTRUM SOUVERAINS EURO 1-3 RC en EUR	C	10 517 351,61	94 985,7960	110,72
OSTRUM SOUVERAINS EURO 1-3 RD en EUR	D	1 233 970,61	13 251,8736	93,11



● 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.	99,64	99,61
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.		
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	0,12	0,12

* 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	37 709 880,66	99,64	99,61
TOTAL		37 709 880,66	99,64	99,61

* 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 **
ITALIE	26,70	26,69
ALLEMAGNE	26,20	26,20
FRANCE	22,93	22,93
ESPAGNE	14,84	14,84
PAYS-BAS	3,22	3,22
PORTUGAL	2,83	2,83
BELGIQUE	1,40	1,40
FINLANDE	1,23	1,23
AUTRICHE	0,28	0,28
TOTAL	99,64	99,61

* 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	0,12	0,12
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE		
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés		
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés		
Autres organismes non européens		
Autres actifs		
Autres		
TOTAL	0,12	0,12

* 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.	60 023 733,80	59 807 324,55
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.		
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.		
E) Les autres actifs.	44 382,40	

• DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt (1) EUR	Montant brut unitaire (2) EUR
Dividendes versés				
25/05/2021	OSTRUM SOUVERAINS EURO 1-3 RD	2,58		2,58
Dividendes à verser				
	OSTRUM SOUVERAINS EURO 1-3 RD			

(1) Le crédit d'impôt unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.
(2) Le montant brut unitaire ne sera déterminé qu'à la date de mise en distribution conformément aux dispositions fiscales en vigueur.

• INFORMATIONS DIVERSES

Etablissement dépositaire : CACEIS Bank - 1-3 place Valhubert - 75013 - Paris

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

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



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

Au cours de l'exercice, l'OPC n'a pas fait l'objet d'opérations relevant de la réglementation SFTR.



● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/09/2021 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				
ALLEMAGNE				
ALLEMAGNE 1.0% 15-08-24	EUR	400 000	420 419,95	1,11
ALLEMAGNE 1.50% 05/23	EUR	4 450 000	4 637 147,49	12,25
ALLEMAGNE 2% 15/08/2023	EUR	3 540 000	3 732 716,63	9,86
BUNDSOBLIGATION ZCP 07-10-22	EUR	800 000	805 744,00	2,13
RFA 1.75% 15/02/2024	EUR	300 000	321 193,60	0,85
TOTAL ALLEMAGNE			9 917 221,67	26,20
AUTRICHE				
AUST GOVE BON 1.75% 20-10-23	EUR	100 000	106 800,29	0,28
TOTAL AUTRICHE			106 800,29	0,28
BELGIQUE				
BGB 2 1/4 06/22/23	EUR	500 000	528 715,48	1,40
TOTAL BELGIQUE			528 715,48	1,40
ESPAGNE				
SPGB 2 3/4 10/31/24	EUR	500 000	562 797,88	1,48
SPGB 3.8 04/30/24	EUR	2 300 000	2 594 020,97	6,86
SPGB 4.4% 10/31/23	EUR	2 150 000	2 460 600,19	6,50
TOTAL ESPAGNE			5 617 419,04	14,84
FINLANDE				
FINNISH GOVERNMENT 1.5% 15/04/2023	EUR	240 000	249 947,64	0,65
RFGB 0 09/15/24	EUR	210 000	214 021,50	0,57
TOTAL FINLANDE			463 969,14	1,22
FRANCE				
FRANCE 1.75% 25/05/2023	EUR	3 600 000	3 767 323,56	9,95
OAT 4.25% 25/10/23	EUR	4 300 000	4 912 426,62	12,99
TOTAL FRANCE			8 679 750,18	22,94
ITALIE				
BUONI 3.75% 01/09/2024	EUR	4 000 000	4 476 994,03	11,83
ITAL BUON POL 0.95% 15-03-23	EUR	400 000	408 267,45	1,08
ITALIE 2.5% 01-12-24	EUR	250 000	273 364,56	0,72
ITALIE 5.50% 11/22	EUR	4 450 000	4 840 466,22	12,79
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.85% 15-05-24	EUR	100 000	106 269,86	0,28
TOTAL ITALIE			10 105 362,12	26,70
PAYS-BAS				
NETHER 2 07/15/24	EUR	450 000	485 904,76	1,28
PAYS BAS 1.75% 07/23	EUR	700 000	733 966,49	1,95
TOTAL PAYS-BAS			1 219 871,25	3,23
PORTUGAL				
PORTUGAL 4.95% 25/10/23	EUR	920 000	1 070 771,49	2,83
TOTAL PORTUGAL			1 070 771,49	2,83
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			37 709 880,66	99,64
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			37 709 880,66	99,64

**● PORTEFEUILLE TITRES DÉTAILLÉ AU 30/09/2021 EN EUR (suite)**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
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	0,3845	44 360,11	0,12
TOTAL FRANCE			44 360,11	0,12
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			44 360,11	0,12
TOTAL Organismes de placement collectif			44 360,11	0,12
Dettes			-11 878,34	-0,03
Comptes financiers			102 789,48	0,27
Actif net			37 845 151,91	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