



## NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

OPCVM de droit français

# OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3

## RAPPORT SEMESTRIEL

au 29 septembre 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	38 292 002,25
b) Avoirs bancaires	38 777,16
c) Autres actifs détenus par l'OPC	1 911 901,56
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	40 242 680,97
e) Passif	-1 896 416,52
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	38 346 264,45

\* 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 EURO BONDS 1-3 I en EUR	C	28 446 935,32	9 212,5833	3 087,83
OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3 M C en EUR	C	398 103,33	182,0000	2 187,38
OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3 R C en EUR	C	8 604 961,48	81 756,0250	105,25
OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3 R D en EUR	D	896 264,32	10 441,0396	85,84



## ● 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.	99,86	95,15
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.	1,94	1,85

\* 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	38 292 002,25	99,86	95,15
TOTAL		38 292 002,25	99,86	95,15

\* 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	31,64	30,15
FRANCE	30,16	28,74
ALLEMAGNE	23,92	22,79
BELGIQUE	6,00	5,72
ESPAGNE	5,70	5,43
GRECE	2,19	2,09
LUXEMBOURG	0,25	0,24
TOTAL	99,86	95,15

\* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

\*\* Se reporter au d) de l'état du patrimoine

**• RÉPARTITION DES AUTRES ACTIFS DU E) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR NATURE**

Nature d'actifs	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
<b>Organismes de placement collectif</b>		
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	1,94	1,85
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
<b>Autres actifs</b>		
Autres	0,00	0,00
<b>TOTAL</b>	<b>1,94</b>	<b>1,85</b>

\* Se reporter au f) de l'état du patrimoine

\*\* Se reporter au d) de l'état du patrimoine



## ● MOUVEMENTS DANS LE PORTEFEUILLE TITRES EN COURS DE PÉRIODE EN EUR

Éléments du portefeuille titres	Mouvements (en montant)	
	Acquisitions	Cessions
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	46 446 837,75	47 003 566,85
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.	1 714 457,75	1 015 778,86

## ● DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
<b>Dividendes versés</b>				
26/05/2023	OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3 R D	0,88	0,00	0,88
<b>Dividendes à verser</b>				
	OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3 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)**

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





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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Obligations et valeurs assimilées</b>				
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
BUNDSOBLIGATION 0.0% 10-10-25	EUR	8 750 000	8 228 587,50	21,46
KRED FU 0.125 06-25	EUR	1 000 000	943 484,45	2,46
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>9 172 071,95</b>	<b>23,92</b>
<b>BELGIQUE</b>				
EUROPEAN UNION 0.8% 04-07-25	EUR	2 100 000	2 005 813,05	5,23
EURO UN 3.125 12-30	EUR	300 000	295 205,59	0,77
<b>TOTAL BELGIQUE</b>			<b>2 301 018,64</b>	<b>6,00</b>
<b>ESPAGNE</b>				
ROYAUME D ESPAGNE 2.15% 31/10/25	EUR	1 300 000	1 292 447,89	3,37
SPAI GO 2.8 05-26	EUR	900 000	892 712,56	2,33
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>2 185 160,45</b>	<b>5,70</b>
<b>FRANCE</b>				
FRAN GO 0.0 02-26	EUR	1 620 000	1 500 735,60	3,91
FRAN GO 0.0 03-25	EUR	4 450 000	4 232 662,00	11,04
FRAN GOVE BON 0.5% 25-05-25	EUR	6 100 000	5 831 170,67	15,21
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>11 564 568,27</b>	<b>30,16</b>
<b>GRECE</b>				
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 4.25% 15-06-33	EUR	640 000	644 277,26	1,68
HELLENIC REPUBLIC GOVERNMENT BOND 4.375% 18-07-38	EUR	200 000	196 762,85	0,51
<b>TOTAL GRECE</b>			<b>841 040,11</b>	<b>2,19</b>
<b>ITALIE</b>				
ITAL BU 3.8 04-26	EUR	1 000 000	1 014 474,10	2,65
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.4% 28-03-25	EUR	6 700 000	6 645 643,12	17,33
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.6% 29-09-25	EUR	4 500 000	4 471 090,22	11,66
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>12 131 207,44</b>	<b>31,64</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
BANQUE EUROPEAN D INVESTISSEMENT 2.75% 30-07-30	EUR	100 000	96 935,39	0,25
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>96 935,39</b>	<b>0,25</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>38 292 002,25</b>	<b>99,86</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées</b>			<b>38 292 002,25</b>	<b>99,86</b>
<b>Organismes de placement collectif</b>				
<b>OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>				
<b>FRANCE</b>				
OSTRUM SRI CASH M	EUR	74	744 432,60	1,94
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>744 432,60</b>	<b>1,94</b>
<b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>			<b>744 432,60</b>	<b>1,94</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>744 432,60</b>	<b>1,94</b>

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Instrument financier à terme</b>				
<b>Engagements à terme fermes</b>				
<b>Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé</b>				
EURO BUND 1223	EUR	-6	-7 140,00	-0,02
<b>TOTAL Engagements à terme fermes sur marché réglementé ou assimilé</b>			<b>-7 140,00</b>	<b>-0,02</b>
<b>TOTAL Engagements à terme fermes</b>			<b>-7 140,00</b>	<b>-0,02</b>
<b>TOTAL Instrument financier à terme</b>			<b>-7 140,00</b>	<b>-0,02</b>
<b>Appel de marge</b>				
APPEL MARGE CACEIS	EUR	7 140	7 140,00	0,02
<b>TOTAL Appel de marge</b>			<b>7 140,00</b>	<b>0,02</b>
<b>Créances</b>			<b>1 160 328,96</b>	<b>3,03</b>
<b>Dettes</b>			<b>-1 889 276,04</b>	<b>-4,93</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>38 776,68</b>	<b>0,10</b>
<b>Actif net</b>			<b>38 346 264,45</b>	<b>100,00</b>



**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