



**NATIXIS INVESTMENT
MANAGERS INTERNATIONAL**

OPCVM de droit français (SICAV)

OSTRUM SRI CASH 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	9 057 743 967,24
b) Avoirs bancaires	764 189 006,11
c) Autres actifs détenus par l'OPC	902 799 037,56
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	10 724 732 010,91
e) Passif	-5 915 552,48
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	10 718 816 458,43

* Les montants sont signés

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

Action	Type d'action	Actif net par action	Nombre d'actions en circulation	Valeur nette d'inventaire par action
OSTRUM SRI CASH PLUS I en EUR	C	7 728 106 459,30	73 924,1145	104 541,07
OSTRUM SRI CASH PLUS N en EUR	C	7 961 394,94	78 218,5763	101,78
OSTRUM SRI CASH PLUS RC en EUR	C	1 922 299 650,11	45 611,5738	42 144,99
OSTRUM SRI CASH PLUS RD en EUR	D	27 670 081,82	1 809,1814	15 294,25
OSTRUM SRI CASH PLUS RE en EUR	C	2 310 346,02	2 239,9216	1 031,44
OSTRUM SRI CASH PLUS TC en EUR	C	1 030 468 526,24	66 334,9177	15 534,33



● ELÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net *	Pourcentage total des actifs **
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier. Et B) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un autre marché réglementé, en fonctionnement régulier, reconnu, ouvert au public et dont le siège est situé dans un Etat membre de l'Union européenne ou dans un autre Etat partie à l'accord sur l'Espace économique européen.	78,99	78,94
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.	5,52	5,51
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.	8,13	8,13

* 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	9 057 743 967,24	84,50	84,46
TOTAL		9 057 743 967,24	84,50	84,46

* 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	49,20	49,18
LUXEMBOURG	7,62	7,61
PAYS-BAS	5,78	5,78
ESPAGNE	5,44	5,44
ITALIE	4,27	4,26
ROYAUME-UNI	3,61	3,61
IRLANDE	2,55	2,54
ALLEMAGNE	1,83	1,83
BELGIQUE	1,44	1,44
ETATS-UNIS	1,15	1,15
SUEDE	1,01	1,00
PORTUGAL	0,39	0,39
FINLANDE	0,23	0,23
TOTAL	84,50	84,46

* 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	8,13	8,13
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	8,13	8,13

* 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.	14 100 130 252,21	14 381 983 762,34
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.	1 284 894 815,68	1 673 974 896,80
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.	221 031 213,49	161 866 180,45

● DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Action	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
Dividendes versés				
07/11/2023	OSTRUM SRI CASH PLUS RD	467,34	0,00	467,34
Dividendes à verser				
	OSTRUM SRI CASH PLUS RD			

● 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
Action OSTRUM SRI CASH PLUS I	
Frais de gestion variables provisionnés	670 009,45
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
Action OSTRUM SRI CASH PLUS N	
Frais de gestion variables provisionnés	585,71
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
Action OSTRUM SRI CASH PLUS RC	
Frais de gestion variables provisionnés	18 583,74
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
Action OSTRUM SRI CASH PLUS RD	
Frais de gestion variables provisionnés	1 172,86
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
Action OSTRUM SRI CASH PLUS RE	
Frais de gestion variables provisionnés	16,09
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
Action OSTRUM SRI CASH PLUS TC	
Frais de gestion variables provisionnés	10 378,27
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

« 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	0,23%	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	563 000,00		0,00		0,00
Rating	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

Monnaie de la garantie					
Euro	563 000,00		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	563 000,00				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	42 899,73	49 788,47	-426 519,82	4 047 345,25	
- Gestionnaire	0,00	0,00	0,00	0,00	
- Tiers	0,00	0,00	0,00	0,00	
Coûts					
- OPC	17 853,83	0,00	0,00	55,46	
- 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				
FRANCE				
SG OISEST+0.03% 05-02-24 EMTN	EUR	150 000 000	154 672 794,33	1,44
VILOGIA STE ANONYME D HLM E3R+0.45% 04-09-24	EUR	10 000 000	10 042 326,67	0,10
TOTAL FRANCE			164 715 121,00	1,54
LUXEMBOURG				
PURPLE PROTECTED ASSET OISEST+0.05% 18-10-24	EUR	150 000 000	151 173 547,17	1,41
PURPLE PROTECTED ASSET OISEST+0.05% 18-11-24	EUR	125 000 000	125 563 831,15	1,17
PURPLE PROTECTED ASSET OISEST+0.08% 17-12-24	EUR	49 000 000	49 228 145,31	0,46
SG ISSUER OISEST+0.03% 17-06-24	EUR	100 000 000	102 047 575,83	0,95
SG ISSUER OISEST+0.03% 27-02-24	EUR	200 000 000	205 900 690,67	1,92
TOTAL LUXEMBOURG			633 913 790,13	5,91
TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			798 628 911,13	7,45
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			798 628 911,13	7,45
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
DEUTSCHE BOERSE AG 170124 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 946 811,80	0,23
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 1101	EUR	18 500 000	18 472 405,77	0,18
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 190124 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 987 960,77	0,04
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 220124 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 958 732,85	0,14
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 290124 FIX 0.0	EUR	12 000 000	11 957 374,02	0,11
FRESENIUS SE 210324 FIX 0.0	EUR	12 000 000	11 886 084,20	0,12
SANTANDER CONSUMER BANK AG 030124 FIX 0.0	EUR	48 000 000	47 973 768,34	0,44
SANTANDER CONSUMER BANK AG 130524 FIX 0.	EUR	25 000 000	24 634 034,05	0,23
SANTANDER CONSUMER BANK AG 260424 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 742 497,40	0,18
SCHAEFFLER AG 260124 FIX 0.0	EUR	16 500 000	16 446 952,55	0,16
TOTAL ALLEMAGNE			196 006 621,75	1,83
BELGIQUE				
BARRY CALLEBAUT SERVICES NV 150124 FIX 0	EUR	11 000 000	10 978 272,05	0,10
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	6 000 000	6 000 000,00	0,06
COFINIMMO SA 060324 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 955 250,00	0,05
COFINIMMO SA 070324 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 962 138,59	0,05
COFINIMMO SA 160224 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 946 162,75	0,09
COFINIMMO SA 290224 FIX 0.0	EUR	13 000 000	12 911 891,97	0,12
KBC BANK NV 291223 FIX 0.0	EUR	100 000 000	100 000 000,00	0,94
TOTAL BELGIQUE			154 742 103,89	1,44
ESPAGNE				
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 07102	EUR	25 000 000	24 279 137,11	0,23
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 09092	EUR	50 000 000	48 675 676,80	0,45
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 170624 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 064 442,88	0,46
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 300424 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 795 090,95	0,14
BANCO SANTANDER SA 020924 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 485 666,73	0,18
BANCO SANTANDER SA 040424 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 469 204,50	0,46



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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BANCO SANTANDER SA 041124 FIX 0.0	EUR	50 000 000	48 436 183,59	0,45
BANCO SANTANDER SA 230824 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 256 312,66	0,27
BANCO SANTANDER SA 310524 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 502 102,20	0,28
BANC SANT ALL SPAI ZCP 04-12-24	EUR	19 000 000	18 356 499,20	0,17
BBVA ZCP 09-02-24	EUR	50 000 000	49 764 369,86	0,46
BBVA ZCP 15-03-24	EUR	100 000 000	99 134 042,11	0,92
BBVA ZCP 19-07-24	EUR	25 000 000	24 454 267,16	0,23
BBVA ZCP 22-05-24	EUR	25 000 000	24 600 722,08	0,23
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A. 120324 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 757 723,20	0,28
Santander Consumer Finance S.A. 201124 F	EUR	25 000 000	24 194 595,78	0,23
TOTAL ESPAGNE			583 226 036,81	5,44
ETATS-UNIS				
DANAHER CORP 120124 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 992 156,57	0,05
HONEYWELL INTERNATIONAL INC 160124 FIX 0	EUR	15 000 000	14 969 944,09	0,14
HONEYWELL INTERNATIONAL INC 210224 FIX 0.0	EUR	40 000 000	39 759 255,72	0,37
HONEYWELL INTERNATIONAL INC 280224 FIX 0.0	EUR	13 500 000	13 408 168,20	0,13
NATIONAL GRID NORTH AMERICA 170124 FIX 0	EUR	50 000 000	49 892 412,28	0,46
TOTAL ETATS-UNIS			123 021 936,86	1,15
FRANCE				
ACCOR SA 220124 FIX 0.0	EUR	8 000 000	7 979 234,84	0,07
ACCOR SA 230224 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 957 413,98	0,06
ACCOR SA 290224 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 952 809,35	0,07
ALSTOM SA 220124 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 942 985,66	0,19
ALSTOM SA 310124 FIX 0.0	EUR	54 000 000	53 788 658,53	0,50
ARKEMA 100924 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 343 719,29	0,23
BEL SA 020224 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 977 656,68	0,05
BFCM (BANQUE FEDE 020724 OISEST 0.3	EUR	50 000 000	50 882 957,69	0,48
BFCM (BANQUE FEDER 021024 OISEST 0.32	EUR	30 000 000	30 319 604,20	0,29
BFCM (BANQUE FEDER 090524 OISEST 0.21	EUR	30 000 000	30 287 514,00	0,29
BFCM (BANQUE FEDER 090524 OISEST 0.31	EUR	50 000 000	51 172 406,67	0,47
BFCM (BANQUE FEDER 150524 OISEST 0.23	EUR	50 000 000	50 622 316,25	0,47
BFCM (BANQUE FEDER 271224 OISEST 0.33	EUR	30 000 000	30 006 660,35	0,28
BFCM B OISEST+0.32% 04-07-24	EUR	70 000 000	71 233 395,16	0,66
BNP PA OISEST+0.26% 16-08-24	EUR	50 000 000	50 798 515,00	0,48
BNP PA OISEST+0.26% 24-07-24	EUR	30 000 000	30 552 201,61	0,29
BNP PARIBAS 070324 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 622 962,25	0,46
BNP PARIBAS 120924 OISEST 0.27	EUR	50 000 000	50 644 711,99	0,48
BNP PARIBAS 160224 OISEST 0.19	EUR	50 000 000	51 090 998,00	0,48
BNP PARIBAS 220324 FIX 0.0	EUR	100 000 000	99 086 109,00	0,93
BPCE 020524 OISEST 0.22	EUR	50 000 000	50 379 742,37	0,47
BPCE 050724 OISEST 0.23	EUR	50 000 000	50 145 287,67	0,47
BPCE SA 030124 OISEST 0.35	EUR	50 000 000	51 808 710,00	0,48
BPCE SA 080424 OISEST 0.24	EUR	50 000 000	50 676 120,58	0,48
BPCE SA 090824 OISEST 0.34	EUR	50 000 000	50 853 796,71	0,47
CA CONSUMER FINANCE 150424 OISEST 0.22	EUR	40 000 000	40 498 676,22	0,37
CA CONSUMER FINANCE 290224 OISEST 0.15	EUR	50 000 000	50 343 114,85	0,47
CAISSE EPARGNE 310124 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 822 360,04	0,46



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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CASA L OISEST+0.17% 13-05-24	EUR	50 000 000	50 099 555,60	0,47
CDC HABITAT 250124 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 923 045,73	0,23
CFCM - COMPAGNIE 140624 OISEST 0.2	EUR	25 000 000	25 126 805,44	0,23
CFCM - COMPAGNIE F 080124 OISEST 0.23	EUR	50 000 000	51 124 780,83	0,47
CFCM - COMPAGNIE F 081124 OISEST 0.31	EUR	25 000 000	25 154 001,48	0,24
CFCM - COMPAGNIE F 090824 OISEST 0.32	EUR	50 000 000	50 840 038,06	0,47
CFCM - COMPAGNIE F 110424 OISEST 0.22	EUR	50 000 000	50 642 958,18	0,47
CFCM - COMPAGNIE F 140524 OISEST 0.17	EUR	25 000 000	25 132 013,75	0,23
CFCM - COMPAGNIE F 150324 OISEST 0.22	EUR	25 000 000	25 388 581,14	0,23
CFCM - COMPAGNIE F 180324 OISEST 0.22	EUR	50 000 000	50 772 109,97	0,47
CFCM - COMPAGNIE F 230724 OISEST 0.22	EUR	50 000 000	50 207 316,00	0,46
COFACE S A E 120224 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 875 052,61	0,23
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 040324 FIX 0	EUR	9 500 000	9 426 630,34	0,09
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 190324 FIX 0	EUR	8 000 000	7 924 122,17	0,07
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 280224 FIX 0	EUR	4 500 000	4 467 885,58	0,04
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 290224 FIX 0	EUR	2 500 000	2 481 865,33	0,02
CREDIT AGRICOLE CORP IB 080324 OISEST 0.3	EUR	40 000 000	40 933 011,33	0,39
CREDIT AGRICOLE SA 010824 OISEST 0.27	EUR	50 000 000	50 394 176,94	0,47
CREDIT AGRICOLE SA 060324 OISEST 0.32	EUR	35 000 000	36 118 705,96	0,34
CREDIT AGRICOLE SA 200524 OISEST 0.27	EUR	60 000 000	60 943 675,30	0,57
CREDIT AGRICOLE SA 260924 OISEST 0.3	EUR	50 000 000	50 562 344,97	0,47
CREDIT AGRICOLE SA 271224 OISEST 0.31	EUR	50 000 000	50 000 297,22	0,47
CREDIT AGRICOLE SA 280624 OISEST 0.36	EUR	50 000 000	51 101 263,89	0,47
CREDIT LYONNAIS 020124 OISEST 0.25	EUR	50 000 000	51 172 251,25	0,48
CREDIT LYONNAIS 070524 OISEST 0.3	EUR	50 000 000	50 858 108,00	0,48
CREDIT LYONNAIS 140224 OISEST 0.33	EUR	60 000 000	62 012 906,60	0,58
CREDIT LYONNAIS 140324 FIX 0.0	EUR	75 000 000	74 380 954,59	0,69
CREDIT LYONNAIS 150424 OISEST 0.23	EUR	50 000 000	50 697 211,85	0,47
CREDIT LYONNAIS 250924 OISEST 0.31	EUR	50 000 000	50 573 658,26	0,47
CREDIT LYONNAIS 280624 OISEST 0.3	EUR	30 000 000	30 436 066,00	0,28
CREDIT LYONNAIS 290224 OISEST 0.14	EUR	50 000 000	50 341 445,40	0,47
CREDIT LYONNAIS 310124 OISEST 0.27	EUR	40 000 000	40 923 149,09	0,38
CRED M OISEST+0.29% 07-06-24	EUR	50 000 000	50 859 508,00	0,47
CRED M OISEST+0.31% 01-11-24	EUR	25 000 000	25 169 552,28	0,23
DANONE SA 050224 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 958 522,64	0,10
DANONE SA 050424 FIX 0.0	EUR	4 500 000	4 452 046,93	0,04
DANONE SA 090224 FIX 0.0	EUR	22 000 000	21 899 150,40	0,20
DANONE SA 140224 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 964 093,83	0,07
DANONE SA 200324 FIX 0.0	EUR	16 000 000	15 856 973,71	0,15
DANONE SA 290124 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 949 240,64	0,14
DASSAULT SYSTEMES 040324 FIX 0.0	EUR	9 000 000	8 935 568,45	0,09
EDF 030424 FIX 0.0	EUR	100 000 000	98 935 532,82	0,92
EDF 050124 FIX 0.0	EUR	34 000 000	33 973 477,10	0,32
EDF 210324 FIX 0.0	EUR	74 000 000	73 317 611,20	0,68
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 260124 FIX 0.0	EUR	100 000 000	99 688 408,37	0,93
ENGIE SA 050124 OISEST 0.15	EUR	115 000 000	116 093 891,88	1,09
ENGIE SA 080124 OISEST 0.08	EUR	12 500 000	12 572 118,13	0,11



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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ENGIE SA 120124 OISEST 0.07	EUR	50 000 000	50 093 744,49	0,47
ENGIE SA 150124 OISEST 0.09	EUR	50 000 000	50 083 601,25	0,46
ENGIE SA 220124 OISEST 0.09	EUR	100 000 000	100 089 771,11	0,94
ENGIE SA 290224 FIX 0.0	EUR	10 500 000	10 428 357,76	0,10
GECINA 010324 FIX 0.0	EUR	2 500 000	2 482 778,27	0,02
GECINA 050224 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 916 865,23	0,18
GECINA 100124 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 967 139,91	0,24
GECINA 200324 FIX 0.0	EUR	23 000 000	22 793 952,04	0,22
KERING FINANCE 250124 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 847 608,38	0,47
KLEPIERRE 080224 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 968 121,43	0,07
KLEPIERRE 081124 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 690 345,02	0,09
LA BANQUE POSTALE 130524 OISEST 0.175	EUR	100 000 000	100 916 282,67	0,94
LA BANQUE POSTALE 220124 OISEST 0.19	EUR	100 000 000	102 222 146,67	0,96
LA POSTE 230124 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 864 203,15	0,47
NATI OISEST+0.19% 12-03-24	EUR	50 000 000	50 628 721,00	0,47
NATIXIS 130524 OISEST 0.33	EUR	40 000 000	40 930 813,29	0,39
NATIXIS 201224 OISEST 0.34	EUR	50 000 000	50 052 213,33	0,46
NATIXIS 250324 OISEST 0.24	EUR	50 000 000	50 741 059,00	0,48
NATIXIS 260724 OISEST 0.33	EUR	30 000 000	30 558 349,20	0,28
NATIXIS 300424 OISEST 0.27	EUR	50 000 000	50 889 339,17	0,47
NATIXIS 300924 OISEST 0.27	EUR	50 000 000	50 004 541,67	0,47
PERNOD RICARD 010324 FIX 0.0	EUR	28 000 000	27 804 396,07	0,26
PERNOD RICARD 180124 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 977 794,42	0,09
PERNOD RICARD 220124 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 973 361,15	0,09
PR FINA SA PAUL RI ZCP 26-02-24	EUR	20 000 000	19 869 137,83	0,19
SCHNEIDER ELECTRIC SE 050224 FIX 0.0	EUR	12 000 000	11 949 285,11	0,11
SCHNEIDER ELECTRIC SE 080124 FIX 0.0	EUR	6 500 000	6 492 760,39	0,06
SCHNEIDER ELECTRIC SE 260124 FIX 0.0	EUR	52 000 000	51 838 040,68	0,48
SCHNEIDER ELECTRIC SE 290124 FIX 0.0	EUR	8 000 000	7 972 415,20	0,08
SEB SA 050224 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 970 159,89	0,07
SEB SA 110124 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 978 094,54	0,14
SEB SA 190224 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 970 840,88	0,05
SG OISEST+0.33% 02-12-24	EUR	30 000 000	30 111 630,83	0,28
SG OISEST+0.35% 21-01-25	EUR	15 000 000	15 016 267,33	0,14
SG OISEST+0.35% 31-10-24	EUR	50 000 000	50 354 953,74	0,47
SG OISEST+0.37% 31-01-24	EUR	50 000 000	51 746 201,39	0,48
SOCIETE FINANCIERE AGACHE 150424 FIX 0.0	EUR	12 000 000	11 857 841,09	0,11
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 140224 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 946 993,60	0,09
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 150124 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 980 803,31	0,10
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 170124 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 987 128,89	0,05
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 190224 FIX 0.0	EUR	35 000 000	34 794 761,94	0,32
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 290124 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 982 513,65	0,04
SOCIETE GENERALE SA 020224 OISEST 0.22	EUR	50 000 000	51 035 686,11	0,47
SOCIETE GENERALE SA 310524 OISEST 0.34	EUR	40 000 000	40 989 868,13	0,38
SOCIETE GENERALE SA 310524 OISEST 0.35	EUR	25 000 000	25 621 214,81	0,24
SOCIETE GENERALE SA 310724 OISEST 0.3	EUR	50 000 000	50 734 476,67	0,48
SOCIETE GENERALE SA 310724 OISEST 0.36	EUR	50 000 000	50 936 414,17	0,47



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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SODEXO 190124 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 977 296,41	0,10
SODEXO 220124 FIX 0.0	EUR	13 000 000	12 966 276,44	0,12
TECHNIP EURO CASH SNC 300124 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 981 991,76	0,05
THALES SA 160124 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 959 724,27	0,19
THAL SERV SAS ZCP 29-01-24	EUR	60 000 000	59 791 990,31	0,56
VALEO SA 050324 FIX 0.0	EUR	15 500 000	15 384 508,83	0,14
VALEO SA 060324 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 969 750,63	0,04
VALEO SA 100624 FIX 0.0	EUR	3 500 000	3 436 043,06	0,03
VALEO SA 120624 FIX 0.0	EUR	24 000 000	23 556 114,08	0,22
VALEO SA 170624 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 923 798,36	0,03
VEOL ENVIRONMENTAL ZCP 09-05-24	EUR	50 000 000	49 293 904,26	0,46
VEOL ENVIRONMENTAL ZCP 27-03-24	EUR	50 000 000	49 514 033,51	0,47
VEOLIA ENVIRONNEMENT. 100624 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 136 631,17	0,46
VEOLIA ENVIRONNEMENT. 180424 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 400 340,38	0,46
VEOLIA ENVIRONNEMENT. 290424 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 672 209,95	0,23
VEOLIA ENVIRONNEMENT 140224 OISEST 0.15	EUR	35 000 000	35 537 748,47	0,33
VEOLIA ENVIRONNEMENT 150224 FIX 0.0	EUR	12 000 000	11 936 662,48	0,11
VEOLIA ENVIRONNEMENT 150424 OISEST 0.165	EUR	50 000 000	50 608 648,06	0,47
VEOLIA ENVIRONNEMENT 230224 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 692 149,40	0,47
TOTAL FRANCE			5 109 255 141,87	47,67
IRLANDE				
DXC CAPITAL FUNDING DAC 010224 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 979 094,19	0,05
DXC CAPITAL FUNDING DAC 040324 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 837 893,99	0,18
DXC CAPITAL FUNDING DAC 050124 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 995 687,35	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	4 000 000	3 990 643,96	0,04
DXC CAPITAL FUNDING DAC 260124 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 982 779,62	0,05
DXC CAPITAL FUNDING DAC 270224 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 963 144,52	0,04
DXC CAPITAL FUNDING DAC 280224 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 962 531,52	0,04
DXC CAPITAL FUNDING DAC 300124 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 980 322,63	0,05
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 041124	EUR	50 000 000	48 459 137,14	0,45
TYCO INTERNATIONAL LTD 040124 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 993 199,63	0,10
TYCO INTERNATIONAL LTD 110324 FIX 0.0	EUR	40 000 000	39 669 979,05	0,37
TOTAL IRLANDE			154 302 425,78	1,44
ITALIE				
ENI SPA 170124 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 894 383,02	0,47
ENI SPA 280224 FIX 0.0	EUR	40 000 000	39 730 747,48	0,37
SNAM SPA 040324 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 925 551,25	0,09
SNAM SPA 040324 FIX 0.0	EUR	59 000 000	58 560 752,39	0,55
SNAM SPA 100124 FIX 0.0	EUR	14 000 000	13 981 008,20	0,13
SNAM SPA 100124 FIX 0.0	EUR	12 000 000	11 983 721,31	0,11
SNAM SPA 190324 FIX 0.0	EUR	4 500 000	4 458 914,67	0,04
SNAM SPA 190324 FIX 0.0	EUR	28 000 000	27 744 357,94	0,26
TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE 130224 FIX 0.0	EUR	58 000 000	57 703 485,83	0,53
TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE 150424 FIX 0.0	EUR	35 000 000	34 582 642,83	0,33
UNICREDIT SPA 110324 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 604 432,48	0,46
UNICREDIT SPA 250324 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 529 343,70	0,47



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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
LUXEMBOURG				
ARCELORMITTAL 150224 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 973 452,37	0,04
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG 050624 F	EUR	50 000 000	49 141 555,99	0,46
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG 150324 F	EUR	30 000 000	29 745 668,34	0,28
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG 230224 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 691 542,51	0,47
TOTAL LUXEMBOURG			133 552 219,21	1,25
PAYS-BAS				
AKZO NOBEL NV 100524 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 639 595,54	0,23
AKZO NOBEL NV 170124 FIX 0.0	EUR	9 000 000	8 981 201,80	0,08
AKZO NOBEL NV 190224 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 971 447,71	0,05
AKZO NOBEL NV 200524 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 226 989,14	0,46
ECOLAB INC 220224 FIX 0.0	EUR	27 000 000	26 831 736,32	0,25
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 291223 FIX	EUR	12 500 000	12 500 000,00	0,12
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 291223 FIX	EUR	53 500 000	53 500 000,00	0,50
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 291223 FIX 0.0	EUR	57 000 000	57 000 000,00	0,53
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 310124 FIX	EUR	76 000 000	75 714 475,04	0,71
ENEL SPA 220124 FIX 0.0	EUR	24 000 000	23 934 395,82	0,22
FERROVIAL SE 040324 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 963 005,92	0,05
FERROVIAL SE 120224 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 848 578,16	0,28
FERROVIAL SE 190224 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 854 204,41	0,23
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 250124 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 850 843,78	0,46
ING BANK N.V. 110924 FIX 0.0	EUR	50 000 000	48 703 570,61	0,45
ING BANK N.V. 280524 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 197 379,60	0,46
TELEFONICA EUROPE BV 020224 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 920 407,18	0,19
TELEFONICA EUROPE BV 080124 FIX 0.0	EUR	16 000 000	15 981 780,33	0,15
TENNET HOLDING BV 200224 FIX 0.0	EUR	16 000 000	15 905 624,02	0,15
TENNET HOLDING BV 220224 FIX 0.0	EUR	23 000 000	22 859 232,53	0,21
TOTAL PAYS-BAS			619 384 467,91	5,78
PORTUGAL				
REN-REDES ENERGETICAS NACIONAI 290124 FI	EUR	42 000 000	41 851 275,91	0,39
TOTAL PORTUGAL			41 851 275,91	0,39
ROYAUME-UNI				
MIZUHO BANK, LTD 140324 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 578 998,83	0,46
SSE PLC. 080124 FIX 0.0	EUR	16 000 000	15 981 946,62	0,15
SSE PLC. 120224 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 923 964,27	0,14
SSE PLC. 160124 FIX 0.0	EUR	26 000 000	25 947 220,75	0,24
SSE PLC. 190124 FIX 0.0	EUR	11 500 000	11 472 771,10	0,10
SSE PLC. 230224 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 936 932,06	0,09
SSE PLC. 290124 FIX 0.0	EUR	19 000 000	18 933 633,09	0,17
SSE PLC. 310124 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 925 635,20	0,19
THE TORO BANK LOND ZCP 30-09-24	EUR	25 000 000	24 316 830,80	0,23
TORONTO DOMINION BANK, THE 020824 FIX 0.0	EUR	50 000 000	48 893 765,65	0,46
TORONTO DOMINION BANK, THE 160924 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 215 875,44	0,27
UBS AG, LONDON BRANCH 071124 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 069 789,51	0,27
UBS AG LONDON 270624 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 424 716,87	0,28



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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
UBS AG LONDON BRANCH 080824 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 307 678,95	0,27
TOTAL ROYAUME-UNI			356 929 759,14	3,32
SUEDE				
ESSITY AB 310124 FIX 0.0	EUR	10 500 000	10 461 268,98	0,10
VATTENFALL AB 070624 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 132 543,38	0,46
VATTENFALL AB 100624 FIX 0.0	EUR	24 000 000	23 576 263,04	0,21
VATTENFALL AB 110624 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 556 052,16	0,23
TOTAL SUEDE			107 726 127,56	1,00
TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			8 037 366 451,20	74,98
Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
FINLANDE				
NORDEA BANK ABP. 260824 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 394 791,05	0,22
TOTAL FINLANDE			24 394 791,05	0,22
IRLANDE				
DXC CAPITAL FUNDING DAC 020224 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 982 784,03	0,04
DXC CAPITAL FUNDING DAC 110124 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 990 392,38	0,06
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	5 000 000	4 987 690,38	0,05
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 090524	EUR	50 000 000	49 281 736,76	0,46
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 160424 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 403 257,23	0,46
TOTAL IRLANDE			118 618 202,75	1,11
LUXEMBOURG				
INTE BANK LUXE ZCP 13-08-24	EUR	50 000 000	48 815 406,30	0,46
TOTAL LUXEMBOURG			48 815 406,30	0,46
ROYAUME-UNI				
GLAXOSMITHKLINE FINANCE PLC 220124 FIX 0	EUR	30 000 000	29 920 204,81	0,28
TOTAL ROYAUME-UNI			29 920 204,81	0,28
TOTAL Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé			221 748 604,91	2,07
TOTAL Titres de créances			8 259 115 056,11	77,05
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	2 983	354 716 170,36	3,31
OSTRUM SRI CASH A1P1 Part ID	EUR	1	109 532,74	0,01
OSTRUM SRI CASH M	EUR	50 901	516 946 992,93	4,82
TOTAL FRANCE			871 772 696,03	8,14
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			871 772 696,03	8,14
TOTAL Organismes de placement collectif			871 772 696,03	8,14
Titres reçus en pension				
ITALIE				
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.8% 15-06-29	EUR	26 530 000	24 712 695,00	0,23
TOTAL ITALIE			24 712 695,00	0,23
TOTAL Titres reçus en pension			24 712 695,00	0,23
Indemnités sur titres reçus en pension			217 036,50	0,00
Instrument financier à terme				



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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				
E3R/0.0/FIX/3.131	EUR	48 000 000	-1 003 849,33	-0,01
ESTR/0.0/FIX/3.9227	EUR	11 500 000	-398,89	0,00
ESTR/0.0/FIX/3.9232	EUR	5 000 000	-183,36	0,00
ESTR/0.0/FIX/3.928	EUR	6 000 000	-285,00	0,00
OISEST/0/FIX/3.9222	EUR	10 000 000	-45,60	0,00
OISEST/0/FIX/3.9237	EUR	5 000 000	-42,80	0,00
OISEST/0/FIX/3.9317	EUR	5 000 000	-112,80	0,00
OISEST/0/FIX/3.9367	EUR	50 000 000	-11 528,00	0,00
OISEST/0./FIX/3.9212	EUR	9 000 000	-19,73	0,00
OISEST/0./FIX/3.9212	EUR	50 000 000	-109,61	0,00
OISEST/0./FIX/3.9212	EUR	6 000 000	-13,15	0,00
OISEST/0./FIX/3.9217	EUR	4 000 000	-12,82	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.119	EUR	40 000 000	115 220,59	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.395	EUR	19 000 000	-12 505,43	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.494	EUR	25 000 000	61 535,58	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.529	EUR	15 000 000	28 649,93	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.532	EUR	20 000 000	36 310,39	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.554	EUR	30 000 000	60 094,50	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.56	EUR	30 000 000	17 042,34	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.598	EUR	25 000 000	41 315,88	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.599	EUR	25 000 000	11 348,84	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.689	EUR	25 000 000	-73 551,59	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.689	EUR	50 000 000	-114 024,36	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.709	EUR	10 000 000	-26 307,50	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.713	EUR	50 000 000	-125 841,03	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.714	EUR	30 000 000	-79 460,83	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.732	EUR	30 000 000	-10 665,60	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.737	EUR	25 000 000	-11 873,86	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.741	EUR	20 000 000	-13 583,63	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.747	EUR	25 000 000	-23 214,50	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.749	EUR	16 000 000	4 341,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.75	EUR	30 000 000	-11 046,97	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.758	EUR	24 000 000	1 416,58	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.770	EUR	25 000 000	-741,87	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.770	EUR	50 000 000	1 632,64	-0,01
OISEST/0.0/FIX/3.773	EUR	25 000 000	11 042,70	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.774	EUR	3 500 000	-86,10	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.774	EUR	24 000 000	-1 647,91	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.777	EUR	50 000 000	-60 043,20	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.778	EUR	50 000 000	-26 771,37	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.778	EUR	10 000 000	5 025,72	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.78	EUR	50 000 000	-38 681,67	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.782	EUR	50 000 000	25 784,63	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.783	EUR	10 000 000	5 097,76	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.785	EUR	50 000 000	30 686,46	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/3.785	EUR	4 000 000	-792,76	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.786	EUR	20 000 000	8 855,13	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.788	EUR	50 000 000	-1 319,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.788	EUR	12 000 000	5 845,81	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.788	EUR	50 000 000	-10 667,77	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.792	EUR	7 000 000	3 182,91	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.799	EUR	50 000 000	14 197,64	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.801	EUR	15 000 000	4 480,19	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.805	EUR	12 000 000	5 294,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.809	EUR	25 000 000	-17 060,39	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.809	EUR	25 000 000	-57 980,29	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.809	EUR	7 000 000	2 893,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.813	EUR	50 000 000	25 611,50	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.821	EUR	50 000 000	24 739,71	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.837	EUR	30 000 000	-23 841,37	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.849	EUR	50 000 000	12 850,36	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.850	EUR	50 000 000	12 712,17	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.859	EUR	30 000 000	-65 695,95	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.862	EUR	50 000 000	-108 779,23	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.865	EUR	15 000 000	2 639,88	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.865	EUR	16 000 000	2 504,54	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.875	EUR	50 000 000	-22 415,28	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.877	EUR	25 000 000	-76 401,88	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.888	EUR	50 000 000	-15 848,42	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.890	EUR	50 000 000	-21 281,03	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.892	EUR	50 000 000	-10 595,84	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.893	EUR	25 000 000	-5 678,13	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.893	EUR	100 000 000	15 132,50	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.901	EUR	30 000 000	3 329,75	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.906	EUR	25 000 000	-5 864,23	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.921	EUR	18 500 000	-19,55	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.921	EUR	5 000 000	-7,07	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.922	EUR	20 000 000	-79,35	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.923	EUR	10 000 000	-60,37	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.924	EUR	5 000 000	-64,34	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.924	EUR	11 000 000	-81,40	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.924	EUR	20 000 000	-257,29	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.924	EUR	10 500 000	-143,68	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.926	EUR	25 000 000	-496,94	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.926	EUR	52 000 000	-928,37	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.926	EUR	6 000 000	-84,18	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.927	EUR	9 000 000	-186,68	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.928	EUR	5 000 000	-98,48	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.929	EUR	19 000 000	-496,43	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.929	EUR	50 000 000	-1 312,64	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.929	EUR	60 000 000	-1 571,20	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.930	EUR	50 000 000	-1 352,09	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/3.930	EUR	33 000 000	-850,85	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.931	EUR	5 000 000	-148,76	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.931	EUR	12 000 000	-2 101,77	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.931	EUR	24 000 000	-679,47	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.932	EUR	50 000 000	-9 675,59	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.932	EUR	8 000 000	-260,02	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.933	EUR	12 000 000	-433,53	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.933	EUR	5 000 000	-180,64	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.933	EUR	50 000 000	-1 762,62	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.933	EUR	5 000 000	-176,26	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.940	EUR	20 000 000	-1 144,22	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.941	EUR	50 000 000	-21 176,25	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.947	EUR	40 000 000	-3 756,00	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.947	EUR	54 000 000	-3 928,80	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.950	EUR	20 000 000	-1 675,63	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.955	EUR	4 500 000	-1 009,10	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.956	EUR	50 000 000	-10 783,83	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.959	EUR	50 000 000	-11 975,39	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.961	EUR	50 000 000	-12 198,42	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.974	EUR	24 000 000	-5 822,52	0,00
OISEST/0.0/FIX/3.974	EUR	16 000 000	-3 869,77	0,00
OISEST 0/FIX 3.9242	EUR	6 000 000	-49,06	0,00
TOTAL Swaps de taux			-1 590 954,01	-0,02
TOTAL Autres instruments financiers à terme			-1 590 954,01	-0,02
TOTAL Instrument financier à terme			-1 590 954,01	-0,02
Créances			5 495 795,40	0,06
Dettes			-3 708 889,12	-0,04
Comptes financiers			764 174 111,39	7,13
Actif net			10 718 816 458,43	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