



## NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

OPCVM de droit français

**OSTRUM ISR CASH EONIA**

**RAPPORT SEMESTRIEL**

au 30 septembre 2021

**Société de gestion : Natixis Investment Managers International**

**Dépositaire : CACEIS Bank**

**Commissaire aux comptes : Deloitte**

**• 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	6 098 119 695,29
b) Avoirs bancaires	1 527 592 457,38
c) Autres actifs détenus par l'OPC	474 299 380,10
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	8 100 011 532,77
e) Passif	-517 658,12
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	8 099 493 874,65

\* 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 ISR CASH EONIA E en EUR	C	22 514 135,47	3 235,68970	6 958,06
OSTRUM ISR CASH EONIA M en EUR	C/D/R	2 506 051 999,46	254 758,29893	9 836,97
OSTRUM ISR CASH EONIA Part C en EUR	C	445 291 034,58	1 483 585,07159	300,145
OSTRUM ISR CASH EONIA Part D en EUR	C/D/R	14 835 593,56	72 013,66343	206,010
OSTRUM ISR CASH EONIA Part G1 en EUR	C	993,39	1,00000	993,39
OSTRUM ISR CASH EONIA Part I en EUR	C	4 822 932 465,52	448 203,78237	10 760,57
OSTRUM ISR CASH EONIA Part P en EUR	C	171 377 196,71	53 845,81420	3 182,73
OSTRUM ISR CASH EONIA Part T en EUR	C	651 297,66	207,86046	3 133,34
OSTRUM ISR CASH EONIA Part Z en EUR	C/D/R	94 416 005,27	9 617,00000	9 817,61
OSTRUM ISR CASH EONIA Part Z2 en EUR	C/D/R	21 423 153,03	2 181,00000	9 822,62



## ● 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.	72,58	72,58
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.	2,71	2,71
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.	2,13	2,13

\* 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	6 098 119 695,29	75,29	75,29
TOTAL		6 098 119 695,29	75,29	75,29

\* 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	56,53	56,53
PAYS-BAS	6,27	6,27
ITALIE	3,98	3,98
ESPAGNE	3,40	3,40
ETATS-UNIS	2,51	2,51
IRLANDE	1,05	1,05
ALLEMAGNE	0,85	0,85
LUXEMBOURG	0,40	0,40
ROYAUME-UNI	0,20	0,20
SUEDE	0,09	0,09
TOTAL	75,29	75,29

\* 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	2,13	2,13
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		
<b>Autres actifs</b>		
Autres		
TOTAL	2,13	2,13

\* 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.	59 601 398 442,44	59 952 273 761,56
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.	2 123 396 383,50	2 327 349 833,04
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.	173 529 658,50	

## ● DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt (1) EUR	Montant brut unitaire (2) EUR
<b>Dividendes versés</b>			

<b>Dividendes à verser</b>			
	OSTRUM ISR CASH EONIA M		
	OSTRUM ISR CASH EONIA Part D		
	OSTRUM ISR CASH EONIA Part Z		
	OSTRUM ISR CASH EONIA Part Z2		

(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)**

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

**a) Titres et matières premières prêtés**

Montant					
% de l'Actif Net*					

\*% 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				301 500 850,00	
% de l'Actif Net				3,72%	

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

NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV PAYS-BAS				105 800 000,00	
REPUBLIQUE FRANCAISE PRESIDENCE FRANCE				87 920 000,00	
CADES CAISSE D AMORTISSEMENT ET DE LA DETTE SOCIALE FRANCE				74 000 850,00	
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT FRANCE				33 780 000,00	

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

B.R.E.D. PARIS FRANCE				121 700 000,00	
NATIXIS FRANCE				105 800 000,00	
LA BANQUE POSTALE FRANCE				74 000 850,00	

**e) Type et qualité des garanties (collatéral)**

Type					
- Actions					
- Obligations					
- OPC					
- TCN					
- Cash					
Rating					





Monnaie de la garantie					



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

**f) Règlement et compensation des contrats**

Triparties				X	
Contrepartie centrale					
Bilatéraux	X			X	

**g) Échéance de la garantie ventilée en fonction des tranches**

Moins d'1 jour					
1 jour à 1 semaine					
1 semaine à 1 mois				74 000 850,00	
1 à 3 mois					
3 mois à 1 an					
Plus d'1 an				121 700 000,00	
Ouvertes				105 800 000,00	

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

Moins d'1 jour					
1 jour à 1 semaine					
1 semaine à 1 mois				195 700 850,00	
1 à 3 mois					
3 mois à 1 an					
Plus d'1 an					
Ouvertes				105 800 000,00	

**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				301 500 850,00	
Cash					



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

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

Titres					
Cash					

**l) Données sur les revenus et les coûts ventilés**

Revenus					
- OPC					
- Gestionnaire					
- Tiers					
Coûts					
- OPC				71 451,47	
- Gestionnaire					
- Tiers					

**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.



### I) 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 30/09/2021 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>ETATS-UNIS</b>				
CITIG 1.375% 27-10-21 EMTN	EUR	7 175 000	7 276 659,43	0,09
CITIGROUP GLOBAL MKTS ZCP 08-12-21	EUR	30 000 000	30 030 900,00	0,37
<b>TOTAL ETATS-UNIS</b>			<b>37 307 559,43</b>	<b>0,46</b>
<b>FRANCE</b>				
SG OISEST+0.085% 29-06-22 EMTN	EUR	370 000 000	369 518 685,19	4,57
ST GOBAIN 3.625% 28/03/2022	EUR	6 935 000	7 203 522,25	0,09
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>376 722 207,44</b>	<b>4,66</b>
<b>ITALIE</b>				
ISPIM 3 1/2 01/17/22	EUR	1 300 000	1 347 412,96	0,01
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>1 347 412,96</b>	<b>0,01</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
BMW FIN 0.25% 14-01-22 EMTN	EUR	2 000 000	2 008 242,74	0,02
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>2 008 242,74</b>	<b>0,02</b>
<b>SUEDE</b>				
VOLVO TREASURY AB E3R+0.65% 01-11-21	EUR	7 000 000	7 005 722,89	0,09
<b>TOTAL SUEDE</b>			<b>7 005 722,89</b>	<b>0,09</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>424 391 145,46</b>	<b>5,24</b>
<b>TOTAL Obligations et valeurs assimilées</b>			<b>424 391 145,46</b>	<b>5,24</b>
<b>Titres de créances</b>				
<b>Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
CONTINENTAL AG 011021 FIX 0.0	EUR	9 800 000	9 800 000,00	0,12
CONTINENTAL AG 041021 FIX 0.0	EUR	9 800 000	9 800 381,81	0,12
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 051021 FIX 0.0	EUR	6 400 000	6 400 174,23	0,08
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 1810	EUR	5 600 000	5 600 647,96	0,07
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 1810	EUR	9 500 000	9 501 099,22	0,11
FRES MEDI CARE AG ZCP 24-03-22	EUR	1 300 000	1 301 404,58	0,02
SAP SE 100222 FIX 0.0	EUR	15 700 000	15 728 368,21	0,20
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>58 132 076,01</b>	<b>0,72</b>
<b>ESPAGNE</b>				
ENDESA SA 071021 FIX 0.0	EUR	15 000 000	15 001 168,84	0,18
ENDESA SA 071221 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 044 240,50	0,62
ENDESA SA 131221 FIX 0.0	EUR	4 900 000	4 904 703,30	0,06
IBERDROLA SA 191021 FIX 0.0	EUR	9 000 000	9 002 335,21	0,11
SPAI LETR DEL TESO ZCP 10-12-21	EUR	25 000 000	25 029 517,45	0,31
TELEFONICA EUROPE BV 150322 FIX 0.0	EUR	21 700 000	21 754 840,33	0,27
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>125 736 805,63</b>	<b>1,55</b>
<b>ETATS-UNIS</b>				
DANAHER CORP 121021 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 007 039,46	0,62
DANAHER CORP 131021 FIX 0.0	EUR	22 000 000	22 003 378,99	0,27
DANAHER CORP 151021 FIX 0.0	EUR	16 000 000	16 002 867,09	0,20
FIDELITY NATIO 251021 FIX 0.0	EUR	78 000 000	78 026 034,69	0,96



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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>TOTAL ETATS-UNIS</b>			<b>166 039 320,23</b>	<b>2,05</b>
<b>FRANCE</b>				
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 131221 FIX 0	EUR	6 000 000	6 005 845,69	0,08
AIR LIQ FIN ZCP 12-10-21	EUR	45 000 000	45 007 563,77	0,55
ALSTOM SA 201221 FIX 0.0	EUR	40 000 000	40 046 756,81	0,49
ALSTOM SA 300322 FIX 0.0	EUR	15 000 000	15 037 970,88	0,18
BANQUE PALATINE 081021 FIX -0.52	EUR	30 000 000	30 003 208,68	0,37
BANQUE PALATINE 201221 FIX 0.0	EUR	30 000 000	30 036 711,54	0,37
BANQUE POPULAIRE RIVES DE PARIS 031221 F	EUR	120 000 000	120 115 611,28	1,48
BANQUE POPULAIRE RIVES DE PARIS 111021 F	EUR	60 000 000	60 009 168,07	0,74
BIOMERIEUX 091221 FIX 0.0	EUR	8 000 000	8 008 442,23	0,10
BIOMERIEUX 151021 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 001 069,67	0,06
BNP PARIBAS 140122 FIX 0.0	EUR	80 000 000	80 127 743,66	0,99
BNP PARIBAS 151021 FIX 0.0	EUR	200 000 000	200 042 786,93	2,47
BQ PAL OISEST+0.04% 15-10-21	EUR	85 000 000	84 900 862,37	1,05
BRED BANQUE POPULAIRE 011021 FIX 0.0	EUR	120 000 000	120 001 766,69	1,48
BRED BANQUE POPULAIRE 191021 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 001 375,38	0,06
BRED BANQUE POPULAIRE 241121 FIX 0.0	EUR	200 000 000	200 165 136,24	2,47
CA CONSUMER FINANCE 151021 FIX 0.0	EUR	130 000 000	130 027 811,50	1,60
CAISSE FEDERAL 131221 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 022 330,46	0,25
CAISSE FEDERAL 141221 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 011 318,35	0,12
CAISSE FEDERAL 201221 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 012 237,18	0,12
CAISSE FEDERAL 291021 FIX 0.0	EUR	40 000 000	40 017 118,43	0,49
CAISSE REGIONALE 251021 OIS 0.025	EUR	30 000 000	29 873 210,03	0,37
CDC HABITAT 010322 FIX 0.0	EUR	35 000 000	35 080 929,76	0,44
CFCM - COMPAGN 041021 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 001 145,89	0,31
CFCM - COMPAGN 051121 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 002 675,04	0,06
CFCM - COMPAGN 070122 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 074 973,36	0,62
CFCM - COMPAGN 081021 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 005 347,79	0,62
CFCM - COMPAGN 121021 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 004 202,10	0,30
CFCM - COMPAGN 221221 FIX 0.0	EUR	80 000 000	80 100 347,94	0,99
CFCM - COMPAGN 270122 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 090 301,68	0,62
CFCM - COMPAGN 280222 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 114 846,52	0,62
CFCM MAINE ANJOU BASSE NORMANDIE 051021 FIX 0.0	EUR	30 000 000	30 002 291,84	0,37
CFCM MAINE ANJOU BASSE NORMANDIE 101221 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 026 764,73	0,31
CFCM MAINE ANJOU BASSE NORMANDIE 161221	EUR	10 000 000	10 011 624,61	0,13
CFCM MAINE ANJOU BASSE NORMANDIE 201021 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 005 807,24	0,25
CFCM NORD EUROPE 231221 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 012 696,66	0,12
CIE GEN DES ETS MI ZCP 09-11-21	EUR	4 000 000	4 002 384,75	0,05
COFACE 091121 FIX 0.0	EUR	5 500 000	5 503 020,75	0,06
COFACE 181021 FIX 0.0	EUR	40 000 000	40 009 730,14	0,50
CRCAM ANJOU ET MAINE 041021 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 002 291,77	0,62
CRCAM ANJOU ET MAINE 080322 FIX 0.0	EUR	30 000 000	30 071 573,18	0,37
CRCAM ANJOU ET MAINE 240222 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 055 379,35	0,31
CRCAM BRIE PICARDIE 061021 FIX -0.53	EUR	40 000 000	40 003 055,79	0,49
CRCAM NORMANDIE SEINE 240222 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 055 379,35	0,31

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CREDIT LYONNAIS 011021 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 000 000,00	0,61
CREDIT LYONNAIS 011221 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 046 640,69	0,62
CREDIT LYONNAIS 021121 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 012 228,20	0,31
DANONE SA 081221 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 009 920,83	0,12
DANONE SA 101121 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 014 661,37	0,31
DANONE SA 121121 FIX 0.0	EUR	30 000 000	30 018 473,87	0,37
DANONE SA 191121 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 014 370,04	0,25
DANONE SA 201021 FIX 0.0	EUR	43 000 000	43 011 974,65	0,53
DANONE SA 221221 FIX 0.0	EUR	17 500 000	17 520 740,37	0,21
DANONE SA 301121 FIX 0.0	EUR	55 000 000	55 048 396,72	0,68
DIAC 031221 FIX 0.0	EUR	35 000 000	35 031 179,50	0,44
DIAC 041021 FIX -0.42	EUR	20 000 000	20 000 847,70	0,24
DIAC 081021 FIX -0.42	EUR	20 000 000	20 001 978,08	0,25
DIAC 121121 FIX 0.0	EUR	15 000 000	15 008 905,78	0,19
EDF ZCP 04-01-22	EUR	5 000 000	5 007 267,49	0,06
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 011221 FIX 0.0	EUR	21 000 000	21 019 589,09	0,26
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 051021 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 000 611,15	0,12
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 121021 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 008 404,19	0,62
ENGIE SA 021121 FIX 0.0	EUR	40 000 000	40 019 565,12	0,49
ENGIE SA 041021 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 000 229,18	0,06
ENGIE SA 070322 FIX 0.0	EUR	55 000 000	55 132 240,81	0,68
ENGIE SA 081021 FIX -0.526	EUR	26 000 000	26 002 780,85	0,32
ENGIE SA 091121 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 029 809,43	0,62
ENGIE SA 151221 FIX 0.0	EUR	63 500 000	63 572 843,88	0,79
ENGIE SA 171121 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 014 371,43	0,25
ENGIE SA 311221 FIX 0.0	EUR	30 000 000	30 041 766,40	0,37
FRANFINANCE SA 081021 FIX 0.0	EUR	16 000 000	16 001 633,50	0,20
FRANFINANCE SA 250122 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 008 327,18	0,06
GECINA 041021 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 000 456,69	0,13
GECINA 181021 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 002 588,45	0,12
HAVAS SA 111021 FIX 0.0	EUR	16 000 000	16 001 822,43	0,20
ILIAD SA 041121 FIX 0.0	EUR	18 000 000	18 006 122,08	0,22
KERING SA 021221 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 023 703,01	0,31
LA BANQUE POSTALE 171221 FIX 0.0	EUR	330 000 000	330 388 665,56	4,08
LEGRAND SA 061021 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 003 455,10	0,61
METROPOLE DE LYON 011221 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 018 238,67	0,25
METROPOLE DE LYON 041021 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 001 042,96	0,31
METROPOLE DE LYON 301121 FIX 0.0	EUR	13 000 000	13 011 569,45	0,16
PERNOD RICARD 171221 FIX 0.0	EUR	2 200 000	2 202 409,53	0,03
PLASTIC OMNIUM SYSTEMES URBAINS 280122 F	EUR	7 300 000	7 306 412,29	0,09
REGION BOURGOGNE FRANCHE COMTE 221221 FIX 0.0	EUR	30 000 000	30 037 630,48	0,37
REGION DE BRETAGNE 171221 FIX 0.0	EUR	17 000 000	17 019 657,70	0,21
REGION NORD PAS DE CALAIS 031221 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 023 914,73	0,31
REGION NORD PAS DE CALAIS 081221 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 005 199,85	0,07
REGION OCCITANIE 221021 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 006 077,85	0,25
REGION OCCITANIE 221221 FIX 0.0	EUR	40 000 000	40 050 173,97	0,49

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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
REGION OCCITANIE 291021 FIX 0.0	EUR	6 800 000	6 802 218,88	0,08
REGION PROVENCE ALPES CT AZUR 291021 FIX	EUR	150 000 000	150 060 784,62	1,85
RTE EDF TRANSPORT 091221 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 026 381,98	0,31
RTE EDF TRANSPORT 101221 FIX 0.0	EUR	8 000 000	8 008 564,72	0,10
RTE EDF TRANSPORT 171221 FIX 0.0	EUR	40 000 000	40 047 110,98	0,50
RTE EDF TRANSPORT 291021 FIX 0.0	EUR	32 000 000	32 013 694,75	0,40
SAFRAN SA 031221 FIX 0.0	EUR	4 600 000	4 604 216,43	0,06
SCHNEIDER ELECTRIC SE 021121 FIX 0.0	EUR	15 000 000	15 006 960,56	0,19
SCHNEIDER ELECTRIC SE 151121 FIX 0.0	EUR	40 000 000	40 026 107,03	0,49
SCHNEIDER ELECTRIC SE 191021 FIX 0.0	EUR	32 500 000	32 508 481,46	0,40
SCHNEIDER ELECTRIC SE 281221 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 006 263,17	0,06
SCHNEIDER ELECTRIC SE 291021 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 008 120,18	0,25
SCHNEIDER ELECTRIC SE 291021 FIX 0.0	EUR	4 000 000	4 001 624,04	0,05
SEB SA 081021 FIX 0.0	EUR	85 000 000	85 008 967,27	1,05
SEB SA 101121 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 003 000,69	0,06
SEB SA 171121 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 017 578,60	0,31
SEB SA 181121 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 014 356,97	0,25
SEB SA 221021 FIX 0.0	EUR	15 000 000	15 004 748,38	0,19
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 041021 FIX 0.0	EUR	5 400 000	5 400 225,28	0,07
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 121121 FIX 0.	EUR	7 300 000	7 304 265,93	0,09
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 151021 FIX 0.	EUR	2 900 000	2 900 564,68	0,03
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 201021 FIX 0.	EUR	50 000 000	50 013 213,77	0,62
TECHNIP EURO CASH SNC 101121 FIX 0.0	EUR	2 000 000	2 000 932,43	0,02
VAL DOISE ZCP 05-01-22	EUR	33 000 000	33 046 706,01	0,41
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 031121 FIX 0.0	EUR	13 000 000	13 006 274,77	0,16
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 071021 FIX 0.0	EUR	81 000 000	81 007 105,67	1,00
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 140122 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 015 154,60	0,13
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 191121 FIX 0.0	EUR	13 000 000	13 009 319,26	0,16
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>4 202 294 657,49</b>	<b>51,89</b>
<b>IRLANDE</b>				
FRESENIUS FINANCE IRELAND PLC 280222 FIX 0.0	EUR	12 000 000	12 012 337,67	0,15
FRESENIUS FINANCE IRELAND PLC 280222 FIX 0.0	EUR	13 000 000	13 013 365,81	0,15
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>25 025 703,48</b>	<b>0,30</b>
<b>ITALIE</b>				
CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 241221 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 064 249,12	0,62
ITAL BUON ORDI DEL ZCP 14-12-21	EUR	75 000 000	75 089 121,61	0,93
ITAL BUON ORDI DEL ZCP 28-02-22	EUR	100 000 000	100 234 925,61	1,24
ITALY BUONI TES BOT ZCP 310122	EUR	8 000 000	8 015 592,11	0,10
SNAM SPA 101121 FIX 0.0	EUR	14 000 000	14 008 257,09	0,17
SNAM SPA 160322 FIX 0.0	EUR	18 500 000	18 544 165,51	0,22
SNAM SPA 251121 FIX 0.0	EUR	15 000 000	15 012 167,15	0,19
UNICREDIT SPA 140122 FIX 0.0	EUR	40 000 000	40 062 490,81	0,49
<b>TOTAL ITALIE</b>			<b>321 030 969,01</b>	<b>3,96</b>
<b>LUXEMBOURG</b>				
EUROFINS SCIENTIFIC SE 051021 FIX 0.0	EUR	12 000 000	12 000 243,34	0,15
EUROFINS SCIENTIFIC SE 071221 FIX 0.0	EUR	10 500 000	10 503 567,57	0,14





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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
EUROFINS SCIENTIFIC SE 191021 FIX 0.0	EUR	3 160 000	3 160 288,38	0,04
INTESA SANPAOLO S.P.A 201021 FIX 0.0	EUR	7 000 000	7 002 032,53	0,08
<b>TOTAL LUXEMBOURG</b>			<b>32 666 131,82</b>	<b>0,41</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
ABB FINANCE B V 141021 FIX 0.0	EUR	9 000 000	9 001 639,27	0,11
AKZO NOBEL NV 131021 FIX 0.0	EUR	18 900 000	18 903 386,86	0,23
IBERDROLA INTERNATIONAL 111121 FIX 0.0	EUR	30 000 000	30 017 736,15	0,37
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 130122 FIX 0.0	EUR	30 000 000	30 044 360,83	0,38
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 151021 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 002 017,96	0,12
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 170122 FIX 0.0	EUR	13 000 000	13 019 994,81	0,16
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 170122 FIX 0.0	EUR	15 000 000	15 023 070,93	0,19
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 180122 FIX 0.	EUR	50 000 000	50 077 646,64	0,62
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 200122 FIX 0.	EUR	25 000 000	25 039 575,47	0,31
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV 091221 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 019 926,33	0,24
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV 111021 FIX 0.0	EUR	9 200 000	9 201 335,47	0,12
KONINKLIJKE KPN NV 081121 FIX 0.0	EUR	4 000 000	4 002 207,33	0,05
LINDE FINANCE BV 191021 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 001 375,38	0,06
REN FINANCE BV 201021 FIX 0.0	EUR	3 116 667	3 117 272,77	0,04
REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 021121 F	EUR	13 000 000	13 006 358,66	0,16
REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 021121 F	EUR	13 000 000	13 006 358,66	0,16
REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 081021 FIX 0.0	EUR	12 000 000	12 001 283,47	0,15
REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 131021 F	EUR	30 000 000	30 005 501,01	0,37
REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 171121 FIX 0.0	EUR	14 000 000	14 010 060,00	0,17
TELEFONICA EUROPE BV 071221 FIX 0.0	EUR	8 400 000	8 408 607,14	0,10
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>332 909 715,14</b>	<b>4,11</b>
<b>ROYAUME-UNI</b>				
UNICREDIT SPA 261021 FIX 0.0	EUR	7 000 000	7 002 674,63	0,09
UNICREDIT SPA 291021 FIX 0.0	EUR	4 000 000	4 001 711,84	0,05
UNIC SPAL BRAN ZCP 28-10-21	EUR	5 000 000	5 002 063,35	0,06
<b>TOTAL ROYAUME-UNI</b>			<b>16 006 449,82</b>	<b>0,20</b>
<b>TOTAL Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>5 279 841 828,63</b>	<b>65,19</b>
<b>Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>				
<b>ALLEMAGNE</b>				
CONTINENTAL ZCP 20-10-21	EUR	10 700 000	10 702 640,73	0,13
<b>TOTAL ALLEMAGNE</b>			<b>10 702 640,73</b>	<b>0,13</b>
<b>ESPAGNE</b>				
NT CONS FIN ZCP 08-10-21	EUR	150 000 000	150 016 043,38	1,85
<b>TOTAL ESPAGNE</b>			<b>150 016 043,38</b>	<b>1,85</b>
<b>IRLANDE</b>				
DXC CAPI FUND ZCP 15-12-21	EUR	40 000 000	40 045 885,91	0,49
INTE BANK IREL ZCP 13-12-21	EUR	20 000 000	20 022 330,46	0,25
<b>TOTAL IRLANDE</b>			<b>60 068 216,37</b>	<b>0,74</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
ABB FINANCE B V 181021 FIX 0.0	EUR	8 700 000	8 702 072,33	0,11
ABB FINANCE B V ZCP 14-12-21	EUR	9 000 000	9 009 044,48	0,11



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

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 211021 FIX 0.0	EUR	18 000 000	18 004 676,21	0,22
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 221021 FIX 0.0	EUR	8 000 000	8 002 182,26	0,10
KONI AHOL DELH NV ZCP 29-10-21	EUR	62 800 000	62 825 531,60	0,78
REN FINANCE BV 201021 FIX 0.0	EUR	3 000 000	3 000 583,10	0,04
REN FINANCE BV 201021 FIX 0.0	EUR	3 500 000	3 500 680,28	0,04
REPSOL ZCP 30-11-21	EUR	60 000 000	60 055 050,46	0,74
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>173 099 820,72</b>	<b>2,14</b>
<b>TOTAL Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>393 886 721,20</b>	<b>4,86</b>
<b>TOTAL Titres de créances</b>			<b>5 673 728 549,83</b>	<b>70,05</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 A1P1 Part IC	EUR	1 498	172 828 642,70	2,13
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>172 828 642,70</b>	<b>2,13</b>
<b>TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays</b>			<b>172 828 642,70</b>	<b>2,13</b>
<b>TOTAL Organismes de placement collectif</b>			<b>172 828 642,70</b>	<b>2,13</b>
<b>Titres reçus en pension</b>				
<b>FRANCE</b>				
CADES 4.375%06-251021 EMTN	EUR	70 477 000	74 000 850,00	0,92
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.1% 01-03-26	EUR	30 000 000	33 780 000,00	0,41
FRENCH REP 2.1% 25-07-23 IND	EUR	70 000 000	87 920 000,00	1,09
<b>TOTAL FRANCE</b>			<b>195 700 850,00</b>	<b>2,42</b>
<b>PAYS-BAS</b>				
NEDWBK 0.877% 24-06-54 EMTN	EUR	100 000 000	105 800 000,00	1,31
<b>TOTAL PAYS-BAS</b>			<b>105 800 000,00</b>	<b>1,31</b>
<b>TOTAL Titres reçus en pension</b>			<b>301 500 850,00</b>	<b>3,73</b>
<b>Indemnités sur titres reçus en pension</b>			<b>-30 978,73</b>	
<b>Instrument financier à terme</b>				
<b>Autres instruments financiers à terme</b>				
<b>Swaps de taux</b>				
FIX/-559/E3R/0.0	EUR	300 000 000	-733,33	
<b>TOTAL Swaps de taux</b>			<b>-733,33</b>	
<b>TOTAL Autres instruments financiers à terme</b>			<b>-733,33</b>	
<b>TOTAL Instrument financier à terme</b>			<b>-733,33</b>	
<b>Créances</b>			<b>866,13</b>	
<b>Dettes</b>			<b>-516 606,93</b>	<b>-0,01</b>
<b>Comptes financiers</b>			<b>1 527 592 139,52</b>	<b>18,86</b>
<b>Actif net</b>			<b>8 099 493 874,65</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