



**NATIXIS INVESTMENT  
MANAGERS INTERNATIONAL**

# OPCVM de droit français

## **OSTRUM SRI CASH**

### **RAPPORT SEMESTRIEL**

au 30 septembre 2025

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

**Dépositaire : Caceis Bank**

**Commissaire aux Comptes : Deloitte & Associés**



## ÉTAT DU PATRIMOINE EN EUR

| Éléments 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 | 7 763 646 814,41                  |
| b) Avoirs bancaires                                                                                        | 342 168 360,80                    |
| c) Autres actifs détenus par l'OPC                                                                         | 325 699 614,14                    |
| d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)                                                       | 8 431 514 789,35                  |
| e) Passif                                                                                                  | -3 491 379,04                     |
| f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)                                             | 8 428 023 410,31                  |

(\*) Les montants sont signés

## NOMBRE DE PARTS EN CIRCULATION ET VALEUR NETTE D'INVENTAIRE PAR PART

| Part                         | Type de part | Actif net de la part | Nombre de parts en circulation | Valeur nette d'inventaire par part |
|------------------------------|--------------|----------------------|--------------------------------|------------------------------------|
| OSTRUM SRI CASH C-NPF en EUR | C            | 1 162 635 978,02     | 3 562 995,58604                | 326,308                            |
| OSTRUM SRI CASH D-NPF en EUR | C/D          | 29 862 862,12        | 133 335,08097                  | 223,968                            |
| OSTRUM SRI CASH E en EUR     | C            | 38 901 088,40        | 5 142,78447                    | 7 564,20                           |
| OSTRUM SRI CASH I en EUR     | C            | 3 263 842 880,91     | 278 040,31842                  | 11 738,73                          |
| OSTRUM SRI CASH M en EUR     | C/D          | 2 751 020 175,90     | 256 300,05996                  | 10 733,59                          |
| OSTRUM SRI CASH N en EUR     | C            | 107,65               | 1,00000                        | 107,65                             |
| OSTRUM SRI CASH P en EUR     | C            | 907 244 454,70       | 262 159,58510                  | 3 460,65                           |
| OSTRUM SRI CASH R en EUR     | C            | 11 136 005,61        | 104 055,10924                  | 107,02                             |
| OSTRUM SRI CASH T en EUR     | C            | 501 125,21           | 147,08926                      | 3 406,94                           |
| OSTRUM SRI CASH Z en EUR     | C/D          | 218 374 128,21       | 20 393,00000                   | 10 708,28                          |
| OSTRUM SRI CASH Z2 en EUR    | C/D          | 44 504 603,58        | 4 153,96796                    | 10 713,75                          |



## ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

| Eléments du portefeuille titres                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              | Pourcentage actif net<br>(*) | Pourcentage total des<br>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.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 73,41                        | 73,38                                |
| 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.                                                                                                                                                                                                                     | 0,00                         | 0,00                                 |
| 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. | 16,68                        | 16,67                                |
| 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.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 5,86                         | 5,86                                 |

(\*) 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    | 7 359 383 827,13        | 87,32                     | 87,28                             |
| Dollar Us         | USD    | 177 710 824,56          | 2,11                      | 2,11                              |
| Couronne Suédoise | SEK    | 55 441 707,61           | 0,66                      | 0,66                              |
| <b>TOTAL</b>      |        | <b>7 592 536 359,30</b> | <b>90,09</b>              | <b>90,05</b>                      |

(\*) 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<br>(*) | Pourcentage total des<br>actifs (**) |
|--------------|------------------------------|--------------------------------------|
| FRANCE       | 46,95                        | 46,93                                |
| ROYAUME-UNI  | 12,17                        | 12,17                                |
| PAYS-BAS     | 9,31                         | 9,30                                 |
| BELGIQUE     | 5,13                         | 5,13                                 |
| LUXEMBOURG   | 4,45                         | 4,44                                 |
| ETATS-UNIS   | 3,17                         | 3,16                                 |
| ESPAGNE      | 2,90                         | 2,90                                 |
| ALLEMAGNE    | 1,24                         | 1,24                                 |
| NORVEGE      | 1,19                         | 1,19                                 |
| SUEDE        | 1,05                         | 1,05                                 |
| AUTRICHE     | 0,59                         | 0,59                                 |
| CANADA       | 0,49                         | 0,49                                 |
| PORTUGAL     | 0,45                         | 0,45                                 |
| ITALIE       | 0,41                         | 0,41                                 |
| DANEMARK     | 0,35                         | 0,35                                 |
| AUSTRALIE    | 0,21                         | 0,21                                 |
| SUISSE       | 0,05                         | 0,05                                 |
| <b>TOTAL</b> | <b>90,09</b>                 | <b>90,05</b>                         |

(\*) 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<br>(*) | Pourcentage total des<br>actifs (**) |
|-------------------------------------------------------------------|------------------------------|--------------------------------------|
| OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne | 3,83                         | 3,83                                 |
| Autres OPC et fonds d'investissements                             | 0,00                         | 0,00                                 |
| FIA et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne   | 0,00                         | 0,00                                 |
| Autres                                                            | 2,03                         | 2,03                                 |
| <b>TOTAL</b>                                                      | <b>5,86</b>                  | <b>5,86</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**

| Eléments 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.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      | 11 161 828 823,94       | 12 048 980 804,46 |
| 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.                                                                                                                                                                                                                     |                         |                   |
| 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. | 1 872 037 537,68        | 1 875 990 753,55  |
| 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.                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        | 491 000 000,00          | 516 440 698,58    |

**DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE**

|                            | Part                  | Montant net unitaire EUR | Crédit d'impôt EUR | Montant brut unitaire EUR |
|----------------------------|-----------------------|--------------------------|--------------------|---------------------------|
| <b>Dividendes versés</b>   |                       |                          |                    |                           |
|                            | OSTRUM SRI CASH D-NPF | 0,00                     | 0,00               | 0,00                      |
|                            | OSTRUM SRI CASH M     | 0,00                     | 0,00               | 0,00                      |
|                            | OSTRUM SRI CASH Z     | 0,00                     | 0,00               | 0,00                      |
|                            | OSTRUM SRI CASH Z2    | 0,00                     | 0,00               | 0,00                      |
| <b>Dividendes à verser</b> |                       |                          |                    |                           |
|                            | OSTRUM SRI CASH D-NPF |                          |                    |                           |
|                            | OSTRUM SRI CASH M     |                          |                    |                           |
|                            | OSTRUM SRI CASH Z     |                          |                    |                           |
|                            | OSTRUM SRI CASH Z2    |                          |                    |                           |

**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**

|                                                        | 30/09/2025 |
|--------------------------------------------------------|------------|
| <b>Part OSTRUM SRI CASH C-NPF</b>                      |            |
| 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       |
| <b>Part OSTRUM SRI CASH D-NPF</b>                      |            |
| 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       |
| <b>Part OSTRUM SRI CASH E</b>                          |            |
| 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       |
| <b>Part OSTRUM SRI CASH I</b>                          |            |
| Frais de gestion variables provisionnés                | 260 327,21 |
| 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       |
| <b>Part OSTRUM SRI CASH M</b>                          |            |
| 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       |
| <b>Part OSTRUM SRI CASH N</b>                          |            |
| 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       |
| <b>Part OSTRUM SRI CASH P</b>                          |            |
| 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       |

« 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. »



|                                                        | 30/09/2025 |
|--------------------------------------------------------|------------|
| <b>Part OSTRUM SRI CASH R</b>                          |            |
| 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       |
| <b>Part OSTRUM SRI CASH T</b>                          |            |
| 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       |
| <b>Part OSTRUM SRI CASH Z</b>                          |            |
| 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       |
| <b>Part OSTRUM SRI CASH Z2</b>                         |            |
| 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       |

« 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)**

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



## INVENTAIRE DES ACTIFS ET PASSIFS

### Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)                                      | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle       | % Actif Net |
|-----------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------|-----------------------|-------------|
| <b>OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES</b>                                                |        |                     | <b>646 281 206,22</b> | <b>7,67</b> |
| <b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b> |        |                     | <b>475 170 751,11</b> | <b>5,64</b> |
| <b>Automobiles</b>                                                                      |        |                     | <b>6 971 169,59</b>   | <b>0,08</b> |
| VOLK LE 0.25 01-26                                                                      | EUR    | 7 000 000           | 6 971 169,59          | 0,08        |
| <b>Banques commerciales</b>                                                             |        |                     | <b>40 252 813,78</b>  | <b>0,48</b> |
| F 2.33 11/25/25                                                                         | EUR    | 29 650 000          | 30 235 079,79         | 0,36        |
| UNICREDIT 0.325% 19-01-26 EMTN                                                          | EUR    | 10 050 000          | 10 017 733,99         | 0,12        |
| <b>Biotechnologie</b>                                                                   |        |                     | <b>22 629 668,05</b>  | <b>0,27</b> |
| AMGEN 2.0% 25-02-26                                                                     | EUR    | 22 385 000          | 22 629 668,05         | 0,27        |
| <b>Crédit à la consommation</b>                                                         |        |                     | <b>15 666 154,85</b>  | <b>0,19</b> |
| PSA BAN 3.875 01-26                                                                     | EUR    | 15 200 000          | 15 666 154,85         | 0,19        |
| <b>Distribution spécialisée</b>                                                         |        |                     | <b>28 627 915,72</b>  | <b>0,34</b> |
| ARVAL SERVICE LEASE 0.0% 01-10-25                                                       | EUR    | 5 000 000           | 5 000 000,00          | 0,06        |
| ARVAL SERVICE LEASE 4.25% 11-11-25                                                      | EUR    | 10 000 000          | 10 391 824,66         | 0,12        |
| NATL GR 0.41 01-26                                                                      | EUR    | 13 272 000          | 13 236 091,06         | 0,16        |
| <b>Electricité</b>                                                                      |        |                     | <b>17 635 576,44</b>  | <b>0,21</b> |
| EDF 4.0% 12-11-25 EMTN                                                                  | EUR    | 17 000 000          | 17 635 576,44         | 0,21        |
| <b>Gestion immobilière et développement</b>                                             |        |                     | <b>6 576 900,00</b>   | <b>0,08</b> |
| VONOVIA SE 0.0% 01-12-25 EMTN                                                           | EUR    | 6 600 000           | 6 576 900,00          | 0,08        |
| <b>Marchés de capitaux</b>                                                              |        |                     | <b>30 916 135,85</b>  | <b>0,37</b> |
| MEDIOBANCABCA CREDITO FINANZ 0.875% 15-01-26                                            | EUR    | 13 854 000          | 13 887 566,53         | 0,16        |
| VOLK IN 4.125 11-25                                                                     | EUR    | 16 400 000          | 17 028 569,32         | 0,21        |
| <b>Outils et services appliqués aux sciences biologiques</b>                            |        |                     | <b>3 926 016,10</b>   | <b>0,05</b> |
| THER FI 1.4 01-26                                                                       | EUR    | 3 897 000           | 3 926 016,10          | 0,05        |
| <b>Produits pharmaceutiques</b>                                                         |        |                     | <b>4 100 963,43</b>   | <b>0,05</b> |
| COVESTRO AG 0.875% 03-02-26                                                             | EUR    | 4 097 000           | 4 100 963,43          | 0,05        |
| <b>Services aux collectivités</b>                                                       |        |                     | <b>8 103 254,79</b>   | <b>0,10</b> |
| RTE EDF 1.625 11-25                                                                     | EUR    | 8 000 000           | 8 103 254,79          | 0,10        |
| <b>Services aux entreprises</b>                                                         |        |                     | <b>4 685 641,29</b>   | <b>0,06</b> |
| ELIS EX HOLDELIS 2.875% 15-02-26                                                        | EUR    | 4 600 000           | 4 685 641,29          | 0,06        |
| <b>Services clientèle divers</b>                                                        |        |                     | <b>16 155 364,15</b>  | <b>0,19</b> |
| AYVENS 1.25% 02-03-26 EMTN                                                              | EUR    | 16 100 000          | 16 155 364,15         | 0,19        |
| <b>Services financiers diversifiés</b>                                                  |        |                     | <b>268 923 177,07</b> | <b>3,17</b> |
| CODEIS SECURITIES OIEST+0.17% 12-12-25                                                  | EUR    | 120 000 000         | 122 454 596,20        | 1,43        |
| DLR 2 1/2 01/16/26                                                                      | EUR    | 9 000 000           | 9 157 677,53          | 0,11        |
| PURPLE PROTECTED ASSET OIEST+0.1% 17-10-25                                              | EUR    | 50 000 000          | 51 250 311,89         | 0,61        |
| PURPLE PROTECTED ASSET OIEST+0.17% 04-05-26                                             | EUR    | 75 000 000          | 75 690 428,44         | 0,90        |
| TRAT FI 4.125 11-25                                                                     | EUR    | 10 000 000          | 10 370 163,01         | 0,12        |



## Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)                                          | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle         | % Actif Net  |
|---------------------------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------|-------------------------|--------------|
| <b>Obligations et valeurs assimilées non négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b> |        |                     | <b>171 110 455,11</b>   | <b>2,03</b>  |
| <b>Services financiers diversifiés</b>                                                      |        |                     | <b>171 110 455,11</b>   | <b>2,03</b>  |
| CODEIS SECURITIES OISEST+0.17% 15-06-26                                                     | EUR    | 170 000 000         | 171 110 455,11          | 2,03         |
| <b>TITRES DE CRÉANCES</b>                                                                   |        |                     | <b>7 117 365 608,19</b> | <b>84,45</b> |
| <b>Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>                     |        |                     | <b>6 725 757 640,34</b> | <b>79,80</b> |
| <b>Assurance</b>                                                                            |        |                     | <b>29 849 102,41</b>    | <b>0,35</b>  |
| COFACE SA 131125 FIX 0.0                                                                    | EUR    | 20 000 000          | 19 949 321,85           | 0,23         |
| COFACE SA 180326 FIX 0.0                                                                    | EUR    | 10 000 000          | 9 899 780,56            | 0,12         |
| <b>Automobiles</b>                                                                          |        |                     | <b>33 938 790,96</b>    | <b>0,40</b>  |
| RENAULT SA 081025 FIX 0.0                                                                   | EUR    | 10 000 000          | 9 995 573,88            | 0,11         |
| RENAULT SA 101225 FIX 0.0                                                                   | EUR    | 5 000 000           | 4 978 453,53            | 0,06         |
| RENAULT SA 151025 FIX 0.0                                                                   | EUR    | 2 500 000           | 2 497 787,14            | 0,03         |
| RENAULT SA 171025 FIX 0.0                                                                   | EUR    | 4 000 000           | 3 995 954,14            | 0,05         |
| RENAULT SA 191225 FIX 0.0                                                                   | EUR    | 3 500 000           | 3 482 966,42            | 0,04         |
| RENAULT SA 221025 FIX 0.0                                                                   | EUR    | 9 000 000           | 8 988 055,85            | 0,11         |
| <b>Banques</b>                                                                              |        |                     | <b>99 917 064,68</b>    | <b>1,19</b>  |
| MIZUHO BANK, LTD 161025 FIX 0.0                                                             | EUR    | 100 000 000         | 99 917 064,68           | 1,19         |
| <b>Banques commerciales</b>                                                                 |        |                     | <b>3 079 067 967,26</b> | <b>36,53</b> |
| ASN BANK N.V. 160326 FIX 0.0                                                                | EUR    | 75 000 000          | 74 284 277,18           | 0,88         |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 171125                                                      | EUR    | 20 000 000          | 19 945 999,59           | 0,24         |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 15042                                                    | EUR    | 50 000 000          | 49 425 084,67           | 0,59         |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 19032                                                    | EUR    | 150 000 000         | 148 524 155,49          | 1,69         |
| BARCLAYS BANK PLC 241125 FIX 0.0                                                            | EUR    | 75 000 000          | 74 784 821,63           | 0,89         |
| BBVA ZCP 26-11-25                                                                           | EUR    | 25 000 000          | 24 919 669,51           | 0,30         |
| BNP PARIBAS 070426 OISEST 0.22                                                              | EUR    | 95 000 000          | 95 154 864,14           | 1,13         |
| BNP PARIBAS 160326 OISEST 0.22                                                              | EUR    | 100 000 000         | 100 109 913,33          | 1,19         |
| BNP PARIBAS SECURITIES SERVICES 160326 F                                                    | EUR    | 50 000 000          | 49 519 051,98           | 0,59         |
| BPCE SA 050126 OISEST 0.25                                                                  | EUR    | 100 000 000         | 100 760 116,67          | 1,20         |
| CASA L OISEST+0.265% 08-12-25                                                               | EUR    | 50 000 000          | 50 406 373,56           | 0,60         |
| CASA L OISEST+0.27% 12-01-26                                                                | EUR    | 25 000 000          | 25 178 844,02           | 0,30         |
| CFCM MAINE ANJOU B 020326 OISEST 0.24                                                       | EUR    | 20 000 000          | 20 038 701,98           | 0,24         |
| CFCM MAINE ANJOU BA 051225 OISEST 0.245                                                     | EUR    | 25 000 000          | 25 184 585,85           | 0,30         |
| CFCM MAINE ANJOU BA 091225 OISEST 0.245                                                     | EUR    | 30 000 000          | 30 213 546,90           | 0,36         |
| CFCM MAINE ANJOU BA 171125 OISEST 0.245                                                     | EUR    | 20 000 000          | 20 175 325,31           | 0,24         |
| CFCM MAINE ANJOU BA 220126 OISEST 0.235                                                     | EUR    | 30 000 000          | 30 134 389,22           | 0,36         |
| CFCM M OISEST+0.22% 06-10-25                                                                | EUR    | 20 000 000          | 20 227 701,00           | 0,24         |
| CFCM M OISEST+0.22% 08-10-25                                                                | EUR    | 30 000 000          | 30 332 897,73           | 0,36         |
| COMMONWEALTH B 200426 FIX 0.0                                                               | EUR    | 50 000 000          | 49 442 235,96           | 0,59         |
| COOPERATIEVE RABOBANK UA 230326 FIX 0.0                                                     | EUR    | 35 000 000          | 34 655 596,53           | 0,41         |
| CREDIT AGRICOLE LE 020426 OISEST 0.25                                                       | EUR    | 50 000 000          | 50 091 237,00           | 0,59         |
| CREDIT AGRICOLE SA 051125 OISEST 0.25                                                       | EUR    | 100 000 000         | 100 946 040,36          | 1,20         |
| CREDIT AGRICOLE SA 070426 OISEST 0.23                                                       | EUR    | 30 000 000          | 30 050 765,53           | 0,36         |
| CREDIT AGRICOLE SA 090226 OISEST 0.25                                                       | EUR    | 80 000 000          | 80 435 851,00           | 0,95         |



## Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*) | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle       | % Actif Net |
|----------------------------------------------------|--------|---------------------|-----------------------|-------------|
| CREDIT AGRICOLE SA 180326 OISEST 0.23              | EUR    | 100 000 000         | 100 086 976,14        | 1,19        |
| CREDIT MUTUEL ARKEA 010426 OISEST 0.23             | EUR    | 25 000 000          | 25 045 774,79         | 0,30        |
| CREDIT MUTUEL ARKEA 010426 OISEST 0.23             | EUR    | 25 000 000          | 25 042 779,61         | 0,30        |
| CREDIT MUTUEL ARKEA 020426 OISEST 0.23             | EUR    | 25 000 000          | 25 044 201,09         | 0,30        |
| CREDIT MUTUEL ARKEA 240326 OISEST 0.21             | EUR    | 15 000 000          | 15 005 782,01         | 0,18        |
| ERSTE GROUP BANK AG 260326 FIX 0.0                 | EUR    | 25 000 000          | 24 742 912,34         | 0,29        |
| ERSTE GROUP BANK AG 300326 FIX 0.0                 | EUR    | 25 000 000          | 24 736 727,01         | 0,29        |
| ING BANK NEDERLAND NV 151025 OISEST 0.22           | EUR    | 100 000 000         | 101 061 551,50        | 1,20        |
| ING BANK NEDERLAND NV 151225 OISEST 0.21           | EUR    | 50 000 000          | 50 338 808,89         | 0,60        |
| ING BANK NEDERLAND NV 291225 FIX 0.0               | EUR    | 50 000 000          | 49 749 955,34         | 0,59        |
| KBC GROUPE ZCP 18-03-26                            | EUR    | 38 000 000          | 37 612 024,45         | 0,45        |
| LA BANQUE POSTALE. 150426 OISEST 0.21              | EUR    | 100 000 000         | 100 101 868,89        | 1,19        |
| LA BANQUE POSTALE. 160226 FIX 0.0                  | EUR    | 65 000 000          | 64 490 296,64         | 0,77        |
| LA BANQUE POSTALE. 200426 FIX 0.0                  | EUR    | 100 000 000         | 98 833 070,52         | 1,17        |
| LA BANQUE POSTALE. 221225 OISEST 0.205             | EUR    | 25 000 000          | 25 158 699,58         | 0,30        |
| LCL CREDIT LYONNAIS 030226 OISEST 0.25             | EUR    | 75 000 000          | 75 432 511,88         | 0,90        |
| MUFG BANK, LTD., LONDON BRANCH 031025 FI           | EUR    | 100 000 000         | 99 988 777,37         | 1,19        |
| MUFG BANK, LTD., LONDON BRANCH 150126 FI           | EUR    | 50 000 000          | 49 697 008,93         | 0,59        |
| MUFG BANK, LTD., LONDON BRANCH 200426 FI           | EUR    | 100 000 000         | 98 831 325,34         | 1,17        |
| MUFG BANK, LTD., LONDON BRANCH 230126 FI           | EUR    | 100 000 000         | 99 346 674,74         | 1,18        |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD LONDON 31102           | EUR    | 75 000 000          | 74 879 269,66         | 0,89        |
| NOMURA BANK INTERNATIONAL PLC. 221225 FI           | EUR    | 10 000 000          | 9 952 913,32          | 0,12        |
| NOMURA BANK INTERNATIONAL PLC. 260126 FI           | EUR    | 10 000 000          | 9 932 491,59          | 0,12        |
| RCI BANQUE 260126 FIX 0.0                          | EUR    | 60 000 000          | 59 580 274,84         | 0,71        |
| RCI BANQUE 260226 FIX 0.0                          | EUR    | 14 000 000          | 13 875 654,71         | 0,16        |
| SANTANDER CONSUMER BANK 160126 FIX 0.0             | EUR    | 20 000 000          | 19 875 571,14         | 0,24        |
| SOCIETE GENERALE 020126 FIX 0.0                    | EUR    | 100 000 000         | 99 467 762,10         | 1,18        |
| SOCIETE GENERALE 030326 OISEST 0.22                | EUR    | 100 000 000         | 100 291 102,78        | 1,19        |
| SOCIETE GENERALE 130226 FIX 0.0                    | EUR    | 25 000 000          | 24 804 764,80         | 0,29        |
| SOCIETE GENERALE 261125 OISEST 0.25                | EUR    | 40 000 000          | 40 323 204,62         | 0,48        |
| SOCIETE GENERALE 281125 OISEST 0.25                | EUR    | 100 000 000         | 100 795 184,50        | 1,20        |
| <b>Biens de consommation durables</b>              |        |                     | <b>56 839 138,36</b>  | <b>0,67</b> |
| SEB SA 091025 FIX 0.0                              | EUR    | 6 000 000           | 5 997 172,27          | 0,07        |
| SEB SA 111125 FIX 0.0                              | EUR    | 16 000 000          | 15 961 394,84         | 0,19        |
| SEB SA 281125 FIX 0.0                              | EUR    | 35 000 000          | 34 880 571,25         | 0,41        |
| <b>Boissons</b>                                    |        |                     | <b>5 977 737,31</b>   | <b>0,07</b> |
| HEINEKEN NV 041225 FIX 0.0                         | EUR    | 6 000 000           | 5 977 737,31          | 0,07        |
| <b>Composants automobiles</b>                      |        |                     | <b>35 332 390,30</b>  | <b>0,42</b> |
| CONTINENTAL AG 300126 FIX 0.0                      | EUR    | 19 000 000          | 18 860 782,23         | 0,23        |
| OPMOBILITY 041125 FIX 0.0                          | EUR    | 6 000 000           | 5 986 140,82          | 0,07        |
| OPMOBILITY 061025 FIX 0.0                          | EUR    | 8 500 000           | 8 497 109,09          | 0,10        |
| VALEO SA 301225 FIX 0.0                            | EUR    | 2 000 000           | 1 988 358,16          | 0,02        |
| <b>Crédit à la consommation</b>                    |        |                     | <b>106 587 994,97</b> | <b>1,26</b> |
| NTT FINANCE UK LIMITED 051225 FIX 0.0              | EUR    | 18 000 000          | 17 929 959,85         | 0,21        |
| NTT FINANCE UK LIMITED 051225 FIX 0.0              | EUR    | 14 000 000          | 13 945 524,33         | 0,17        |



## Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)                 | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle       | % Actif Net |
|--------------------------------------------------------------------|--------|---------------------|-----------------------|-------------|
| NTT FINANCE UK LIMITED 161225 FIX 0.0                              | EUR    | 30 000 000          | 29 863 387,94         | 0,35        |
| NTT FINANCE UK LIMITED 161225 FIX 0.0                              | EUR    | 30 000 000          | 29 863 387,94         | 0,35        |
| NTT FINANCE UK LIMITED 171025 FIX 0.0                              | EUR    | 9 000 000           | 8 991 440,95          | 0,11        |
| NTT FINANCE UK LIMITED 171025 FIX 0.0                              | EUR    | 6 000 000           | 5 994 293,96          | 0,07        |
| <b>Distribution de produits alimentaires de première nécessité</b> |        |                     | <b>160 573 211,75</b> | <b>1,91</b> |
| CARREFOUR S A 031125 FIX 0.0                                       | EUR    | 18 100 000          | 18 065 516,99         | 0,21        |
| CARREFOUR S A 110226 FIX 0.0                                       | EUR    | 9 000 000           | 8 930 293,50          | 0,11        |
| CARREFOUR S A 160226 FIX 0.0                                       | EUR    | 20 000 000          | 19 839 116,34         | 0,24        |
| CARREFOUR S A 170226 FIX 0.0                                       | EUR    | 20 000 000          | 19 837 914,38         | 0,24        |
| CARREFOUR S A 220126 FIX 0.0                                       | EUR    | 9 000 000           | 8 941 071,85          | 0,11        |
| REN-REDES ENERGETICAS NACIONAI 011025 FI                           | EUR    | 37 600 000          | 37 600 000,00         | 0,44        |
| SAVENCIA SA 171225 FIX 0.0                                         | EUR    | 13 000 000          | 12 940 712,13         | 0,15        |
| SAVENCIA SA 181125 FIX 0.0                                         | EUR    | 18 000 000          | 17 948 449,66         | 0,21        |
| SAVENCIA SA 311025 FIX 0.0                                         | EUR    | 16 500 000          | 16 470 136,90         | 0,20        |
| <b>Divertissement</b>                                              |        |                     | <b>16 457 853,13</b>  | <b>0,20</b> |
| UNIVERSAL MUSIC GROUP N.V. 121225 FIX 0.0                          | EUR    | 4 500 000           | 4 480 757,83          | 0,05        |
| VIVENDI 141125 FIX 0.0                                             | EUR    | 5 500 000           | 5 484 830,91          | 0,07        |
| VIVENDI 201025 FIX 0.0                                             | EUR    | 6 500 000           | 6 492 264,39          | 0,08        |
| <b>Electricité</b>                                                 |        |                     | <b>57 804 438,29</b>  | <b>0,69</b> |
| EDF 151225 FIX 0.0                                                 | EUR    | 43 000 000          | 42 812 561,26         | 0,51        |
| ORANO SA 101025 FIX 0.0                                            | EUR    | 15 000 000          | 14 991 877,03         | 0,18        |
| <b>Emballage et conditionnement</b>                                |        |                     | <b>6 955 478,56</b>   | <b>0,08</b> |
| VERALLIA SASU 140126 FIX 0.0                                       | EUR    | 7 000 000           | 6 955 478,56          | 0,08        |
| <b>Equipements électriques</b>                                     |        |                     | <b>32 876 602,47</b>  | <b>0,39</b> |
| ALSTOM SA 291025 FIX 0.0                                           | EUR    | 7 500 000           | 7 487 554,85          | 0,09        |
| ALSTOM SA 310326 FIX 0.0                                           | EUR    | 7 000 000           | 6 922 661,94          | 0,08        |
| ALSTOM SA 311025 FIX 0.0                                           | EUR    | 11 000 000          | 10 980 436,52         | 0,13        |
| NEXANS SA 091025 FIX 0.0                                           | EUR    | 2 500 000           | 2 498 724,21          | 0,03        |
| NEXANS SA 101125 FIX 0.0                                           | EUR    | 5 000 000           | 4 987 224,95          | 0,06        |
| <b>Equipements et instruments électroniques</b>                    |        |                     | <b>124 143 665,16</b> | <b>1,47</b> |
| IBERDROLA INTERNATIONAL BV 260126 FIX 0.                           | EUR    | 75 000 000          | 74 493 230,01         | 0,88        |
| IBERDROLA INTERNATIONAL BV 300126 FIX 0.                           | EUR    | 50 000 000          | 49 650 435,15         | 0,59        |
| <b>FPI Bureautiques</b>                                            |        |                     | <b>225 834 842,41</b> | <b>2,68</b> |
| GECINA 090226 FIX 0.0                                              | EUR    | 50 000 000          | 49 621 674,43         | 0,59        |
| GECINA 180326 FIX 0.0                                              | EUR    | 60 000 000          | 59 420 232,83         | 0,70        |
| GECINA 181225 FIX 0.0                                              | EUR    | 15 000 000          | 14 933 811,36         | 0,18        |
| GECINA 230326 FIX 0.0                                              | EUR    | 50 000 000          | 49 503 331,15         | 0,59        |
| GECINA 271025 FIX 0.0                                              | EUR    | 40 000 000          | 39 941 504,78         | 0,47        |
| GECINA 280126 FIX 0.0                                              | EUR    | 12 500 000          | 12 414 287,86         | 0,15        |
| <b>FPI de détail</b>                                               |        |                     | <b>33 430 037,17</b>  | <b>0,40</b> |
| CARMILA SA 011025 FIX 0.0                                          | EUR    | 15 000 000          | 15 000 000,00         | 0,18        |
| CARMILA SA 221225 FIX 0.0                                          | EUR    | 6 000 000           | 5 970 524,38          | 0,07        |
| CARMILA SA 311025 FIX 0.0                                          | EUR    | 9 000 000           | 8 983 915,05          | 0,11        |



## Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)           | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle       | % Actif Net |
|--------------------------------------------------------------|--------|---------------------|-----------------------|-------------|
| KLEPIERRE 300126 FIX 0.0                                     | EUR    | 3 500 000           | 3 475 597,74          | 0,04        |
| <b>FPI Soins de Santé</b>                                    |        |                     | <b>27 915 327,30</b>  | <b>0,33</b> |
| COFINIMMO SA 081225 FIX 0.0                                  | EUR    | 18 000 000          | 17 926 669,56         | 0,21        |
| COFINIMMO SA 201025 FIX 0.0                                  | EUR    | 10 000 000          | 9 988 657,74          | 0,12        |
| <b>Gestion et promotion immobilière</b>                      |        |                     | <b>63 680 680,09</b>  | <b>0,76</b> |
| CDC HABITAT 061125 FIX 0.0                                   | EUR    | 14 000 000          | 13 970 757,81         | 0,17        |
| CDC HABITAT 081225 FIX 0.0                                   | EUR    | 10 000 000          | 9 960 621,24          | 0,12        |
| CDC HABITAT 090226 FIX 0.0                                   | EUR    | 30 000 000          | 29 772 499,32         | 0,35        |
| CDC HABITAT 101125 FIX 0.0                                   | EUR    | 10 000 000          | 9 976 801,72          | 0,12        |
| <b>Industrie aéronautique et défense</b>                     |        |                     | <b>11 904 651,28</b>  | <b>0,14</b> |
| SAFRAN SA 160226 FIX 0.0                                     | EUR    | 12 000 000          | 11 904 651,28         | 0,14        |
| <b>Infrastructure de transports</b>                          |        |                     | <b>1 993 878,79</b>   | <b>0,02</b> |
| ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA 201125 FIX 0                      | EUR    | 2 000 000           | 1 993 878,79          | 0,02        |
| <b>Logiciels</b>                                             |        |                     | <b>205 774 044,61</b> | <b>2,44</b> |
| EVONIK INDUSTRIES 081025 FIX 0.0                             | EUR    | 4 000 000           | 3 998 326,92          | 0,05        |
| ORACLE CORP 121225 FIX 0.0                                   | USD    | 30 000 000          | 25 356 650,11         | 0,30        |
| ORACLE CORP 261125 FIX 0.0                                   | USD    | 47 500 000          | 40 223 916,17         | 0,48        |
| VICAT SA 211025 FIX 0.0                                      | EUR    | 10 000 000          | 9 987 393,69          | 0,12        |
| VINCI OISEST+0.195% 06-10-25                                 | EUR    | 100 000 000         | 101 125 105,00        | 1,19        |
| VINCI SA 061125 OISEST 0.17                                  | EUR    | 25 000 000          | 25 082 652,72         | 0,30        |
| <b>Machines</b>                                              |        |                     | <b>9 571 724,69</b>   | <b>0,11</b> |
| STANLEY BLACK DECKER INC 171025 FIX 0.0                      | USD    | 11 250 000          | 9 571 724,69          | 0,11        |
| <b>Marchés de capitaux</b>                                   |        |                     | <b>185 259 836,90</b> | <b>2,20</b> |
| ABN AMRO BANK NV 131025 FIX 0.0                              | EUR    | 100 000 000         | 99 932 648,73         | 1,19        |
| BANC SANT ALL SPAI ZCP 10-11-25                              | EUR    | 70 000 000          | 69 845 741,80         | 0,83        |
| WPP CP FINANCE PLC 141025 FIX 0.0                            | EUR    | 8 000 000           | 7 993 925,82          | 0,09        |
| WPP CP FINANCE PLC 291025 FIX 0.0                            | EUR    | 7 500 000           | 7 487 520,55          | 0,09        |
| <b>Médias</b>                                                |        |                     | <b>12 474 121,88</b>  | <b>0,15</b> |
| HAVAS SA 071125 FIX 0.0                                      | EUR    | 8 000 000           | 7 980 392,13          | 0,10        |
| HAVAS SA 221025 FIX 0.0                                      | EUR    | 4 500 000           | 4 493 729,75          | 0,05        |
| <b>Outils et services appliqués aux sciences biologiques</b> |        |                     | <b>67 913 685,38</b>  | <b>0,81</b> |
| DANAHER CORP 071025 FIX 0.0                                  | EUR    | 50 000 000          | 49 982 002,31         | 0,59        |
| DANAHER CORP 141125 FIX 0.0                                  | EUR    | 6 000 000           | 5 984 331,56          | 0,07        |
| EUROFINS SCIENTIFIC SE 161225 FIX 0.0                        | EUR    | 9 000 000           | 8 957 986,64          | 0,11        |
| EUROFINS SCIENTIFIC SE 281125 FIX 0.0                        | EUR    | 3 000 000           | 2 989 364,87          | 0,04        |
| <b>Produits alimentaires</b>                                 |        |                     | <b>19 060 079,29</b>  | <b>0,23</b> |
| BARRY CALLEBAUT SERVICES NV 081025 FIX 0                     | EUR    | 4 000 000           | 3 998 145,24          | 0,05        |
| BEL SA 191225 FIX 0.0                                        | EUR    | 5 000 000           | 4 976 556,37          | 0,06        |
| BONDUELLE 011025 FIX 0.0                                     | EUR    | 3 000 000           | 3 000 000,00          | 0,04        |
| BONDUELLE 021025 FIX 0.0                                     | EUR    | 3 100 000           | 3 099 797,56          | 0,04        |
| BONDUELLE 201025 FIX 0.0                                     | EUR    | 2 000 000           | 1 997 519,46          | 0,02        |
| BONDUELLE 291225 FIX 0.0                                     | EUR    | 2 000 000           | 1 988 060,66          | 0,02        |



## Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*) | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle       | % Actif Net |
|----------------------------------------------------|--------|---------------------|-----------------------|-------------|
| <b>Produits chimiques</b>                          |        |                     | <b>13 586 953,74</b>  | <b>0,16</b> |
| AKZO NOBEL NV 141025 FIX 0.0                       | EUR    | 6 000 000           | 5 995 423,38          | 0,07        |
| AKZO NOBEL NV 201025 FIX 0.0                       | EUR    | 7 600 000           | 7 591 530,36          | 0,09        |
| <b>Produits pharmaceutiques</b>                    |        |                     | <b>96 660 238,73</b>  | <b>1,15</b> |
| ABBVIE INC 141125 FIX 0.0                          | USD    | 14 000 000          | 11 871 445,23         | 0,14        |
| COVESTRO AG 181125 FIX 0.0                         | EUR    | 10 000 000          | 9 971 354,29          | 0,12        |
| GLAXOSMITHKLINE FINANCE PLC 121125 FIX 0           | EUR    | 75 000 000          | 74 817 439,21         | 0,89        |
| <b>Services aux collectivités</b>                  |        |                     | <b>533 838 717,31</b> | <b>6,33</b> |
| ENGIE SA 021025 OISEST 0.21                        | EUR    | 40 000 000          | 40 458 533,96         | 0,48        |
| ENGIE SA 051225 OISEST 0.17                        | EUR    | 80 000 000          | 80 120 803,02         | 0,95        |
| ENGIE SA 161225 FIX 0.0                            | EUR    | 100 000 000         | 99 556 928,53         | 1,18        |
| ENGIE SA 221225 FIX 0.0                            | EUR    | 100 000 000         | 99 521 236,50         | 1,18        |
| EWE AG 150126 FIX 0.0                              | EUR    | 8 000 000           | 7 948 378,77          | 0,09        |
| EWE AG 191125 FIX 0.0                              | EUR    | 10 000 000          | 9 970 853,98          | 0,12        |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT 031125 FIX 0.0                | EUR    | 25 000 000          | 24 952 718,55         | 0,30        |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT 031225 OISEST 0.24            | EUR    | 120 000 000         | 120 898 540,00        | 1,43        |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT 241125 OISEST 0.23            | EUR    | 50 000 000          | 50 410 724,00         | 0,60        |
| <b>Services aux entreprises</b>                    |        |                     | <b>62 520 777,91</b>  | <b>0,74</b> |
| ELIS SA EX HOLDELIS SA 200226 FIX 0.0              | EUR    | 4 000 000           | 3 963 809,60          | 0,05        |
| LA POSTE 090126 FIX 0.0                            | EUR    | 25 000 000          | 24 859 481,78         | 0,29        |
| LA POSTE 291225 FIX 0.0                            | EUR    | 10 000 000          | 9 950 076,73          | 0,12        |
| LA POSTE 300326 FIX 0.0                            | EUR    | 20 000 000          | 19 791 408,45         | 0,23        |
| SOCIETE BIC 300326 FIX 0.0                         | EUR    | 4 000 000           | 3 956 001,35          | 0,05        |
| <b>Services aux professionnels</b>                 |        |                     | <b>21 957 302,37</b>  | <b>0,26</b> |
| BUREAU VERITAS 071125 FIX 0.0                      | EUR    | 6 000 000           | 5 986 021,36          | 0,07        |
| TELEPERFORMANCE SE 041125 FIX 0.0                  | EUR    | 6 000 000           | 5 987 631,98          | 0,07        |
| TELEPERFORMANCE SE 281025 FIX 0.0                  | EUR    | 10 000 000          | 9 983 649,03          | 0,12        |
| <b>Services clientèle divers</b>                   |        |                     | <b>36 974 471,26</b>  | <b>0,44</b> |
| ECOLAB NL 11 BV 021025 FIX 0.0                     | EUR    | 25 000 000          | 24 998 443,57         | 0,30        |
| ISS GLOBAL AS 121125 FIX 0.0                       | EUR    | 6 000 000           | 5 984 665,19          | 0,07        |
| ITT INDUSTRIES LUXEMBOURG SARL 221025 FI           | EUR    | 4 000 000           | 3 994 331,51          | 0,05        |
| ITT INDUSTRIES LUXEMBOURG SARL 231025 FI           | EUR    | 2 000 000           | 1 997 030,99          | 0,02        |
| <b>Services de télécommunication diversifiés</b>   |        |                     | <b>22 011 927,48</b>  | <b>0,26</b> |
| TELEFONICA EUROPE BV 101125 FIX 0.0                | EUR    | 8 000 000           | 7 980 746,89          | 0,09        |
| TELUS CORP 030326 FIX 0.0                          | USD    | 10 250 000          | 8 567 302,62          | 0,11        |
| TELUS CORP 160126 FIX 0.0                          | USD    | 6 500 000           | 5 463 877,97          | 0,06        |
| <b>Services de télécommunication mobile</b>        |        |                     | <b>64 908 526,07</b>  | <b>0,77</b> |
| AMERICA MOVIL BV 031025 FIX 0.0                    | EUR    | 21 500 000          | 21 497 418,88         | 0,25        |
| AMERICA MOVIL BV 061125 FIX 0.0                    | EUR    | 5 000 000           | 4 989 219,79          | 0,06        |
| AMERICA MOVIL BV 061125 FIX 0.0                    | EUR    | 11 000 000          | 10 976 283,54         | 0,13        |
| AMERICA MOVIL BV 141125 FIX 0.0                    | EUR    | 9 500 000           | 9 475 005,67          | 0,11        |
| AMERICA MOVIL BV 171025 FIX 0.0                    | EUR    | 5 000 000           | 4 995 198,39          | 0,06        |
| AMERICA MOVIL BV 211125 FIX 0.0                    | EUR    | 4 000 000           | 3 987 818,74          | 0,05        |



## Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)                          | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle         | % Actif Net  |
|-----------------------------------------------------------------------------|--------|---------------------|-------------------------|--------------|
| AMERICA MOVIL BV 241025 FIX 0.0                                             | EUR    | 9 000 000           | 8 987 581,06            | 0,11         |
| <b>Services financiers diversifiés</b>                                      |        |                     | <b>1 115 251 279,38</b> | <b>13,23</b> |
| AMCOR UK FINANCE PLC 151025 FIX 0.0                                         | EUR    | 11 000 000          | 10 990 761,35           | 0,13         |
| AMCOR UK FINANCE PLC 300126 FIX 0.0                                         | EUR    | 60 000 000          | 59 561 219,45           | 0,71         |
| ASSA ABLO FINA SER ZCP 14-11-25                                             | EUR    | 15 000 000          | 14 960 998,51           | 0,18         |
| ASSA ABLO FINA SER ZCP 23-10-25                                             | EUR    | 10 000 000          | 9 987 015,49            | 0,12         |
| AVERY DENNISON 061125 FIX 0.0                                               | EUR    | 12 000 000          | 11 974 556,46           | 0,14         |
| AVERY DENNISON 161225 FIX 0.0                                               | EUR    | 8 000 000           | 7 964 032,04            | 0,09         |
| AVRIL SCA 191225 FIX 0.0                                                    | EUR    | 7 000 000           | 6 962 522,46            | 0,08         |
| BANQUE STELLANTIS FRANCE 130326 OISEST 0                                    | EUR    | 50 000 000          | 50 169 374,86           | 0,60         |
| CA CONSUMER FINANCE 050126 OISEST 0.26                                      | EUR    | 100 000 000         | 100 768 850,00          | 1,20         |
| CA CONSUMER FINANCE 090326 OISEST 0.24                                      | EUR    | 50 000 000          | 50 173 989,31           | 0,60         |
| CA CONSUMER FINANCE 260126 FIX 0.0                                          | EUR    | 50 000 000          | 49 665 295,64           | 0,59         |
| KBC BANK 241125 FIX 0.0                                                     | EUR    | 24 000 000          | 23 921 682,80           | 0,28         |
| NATIXIS 011025 OISEST 0.21                                                  | EUR    | 50 000 000          | 50 577 005,00           | 0,60         |
| NATIXIS 221225 OISEST 0.16                                                  | EUR    | 100 000 000         | 100 786 681,33          | 1,20         |
| PR FINANCE S.A. (PAUL RICARD) 221025 FIX                                    | EUR    | 25 000 000          | 24 969 128,79           | 0,30         |
| PR FINANCE S.A. (PAUL RICARD) 301025 FIX                                    | EUR    | 35 000 000          | 34 940 343,73           | 0,41         |
| PR FINA SA PAUL RI ZCP 06-10-25                                             | EUR    | 25 000 000          | 24 992 646,95           | 0,30         |
| SGS NEDERLAND HOLDING BV 101125 FIX 0.0                                     | EUR    | 7 000 000           | 6 982 247,25            | 0,08         |
| SGS NEDERLAND HOLDING BV 151225 FIX 0.0                                     | EUR    | 9 000 000           | 8 957 062,08            | 0,11         |
| SUEZ SACA 281125 FIX 0.0                                                    | EUR    | 17 400 000          | 17 342 088,70           | 0,21         |
| SUMITOMO ELECTRIC FINANCE UK PLC 271025 FIX 0.0                             | EUR    | 50 000 000          | 49 920 249,63           | 0,59         |
| SUMITOMO MITSU 101125 FIX 0.0                                               | EUR    | 150 000 000         | 149 668 301,78          | 1,76         |
| SUMITOMO MITSU 161025 FIX 0.0                                               | EUR    | 70 000 000          | 69 942 358,75           | 0,83         |
| SUMITOMO MITSU 220426 FIX 0.0                                               | EUR    | 50 000 000          | 49 411 211,07           | 0,59         |
| SUMITOMO MITSU 300326 FIX 0.0                                               | EUR    | 75 000 000          | 74 219 948,34           | 0,88         |
| VOLKSWAGEN FINANS SVERIGE AB 161225 FIX                                     | SEK    | 115 000 000         | 10 360 615,88           | 0,12         |
| VOLKSWAGEN FINANS SVERIGE AB 211025 FIX                                     | SEK    | 150 000 000         | 13 560 861,27           | 0,16         |
| VOLKSWAGEN FINANS SVERIGE AB 231225 FIX                                     | SEK    | 350 000 000         | 31 520 230,46           | 0,37         |
| <b>Services liés aux technologies de l'information</b>                      |        |                     | <b>3 988 175,86</b>     | <b>0,05</b>  |
| CAPGEMINI 211125 FIX 0.0                                                    | EUR    | 4 000 000           | 3 988 175,86            | 0,05         |
| <b>Sociétés d'investissement immobilier cotées (SIIC)</b>                   |        |                     | <b>42 924 924,83</b>    | <b>0,51</b>  |
| COVIVIO SA (EX 221025 FIX 0.0                                               | EUR    | 20 000 000          | 19 975 519,50           | 0,24         |
| COVIVIO SA 031125 FIX 0.0                                                   | EUR    | 13 000 000          | 12 975 013,58           | 0,15         |
| COVIVIO SA 141125 FIX 0.0                                                   | EUR    | 10 000 000          | 9 974 391,75            | 0,12         |
| <b>Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b> |        |                     | <b>391 607 967,85</b>   | <b>4,65</b>  |
| <b>Automobiles</b>                                                          |        |                     | <b>14 719 967,92</b>    | <b>0,17</b>  |
| Gene Moto Fina Co ZCP 23-01-26                                              | USD    | 17 500 000          | 14 719 967,92           | 0,17         |
| <b>Banques commerciales</b>                                                 |        |                     | <b>109 838 899,19</b>   | <b>1,32</b>  |
| DNB BANK A ZCP 16-10-25                                                     | EUR    | 100 000 000         | 99 920 321,87           | 1,20         |
| SANTANDER CONSUMER BANK 170226 FIX 0.0                                      | EUR    | 10 000 000          | 9 918 577,32            | 0,12         |



## Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)           | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle         | % Actif Net  |
|--------------------------------------------------------------|--------|---------------------|-------------------------|--------------|
| <b>Electricité</b>                                           |        |                     | <b>27 927 502,14</b>    | <b>0,33</b>  |
| SSE PLC. 161025 FIX 0.0                                      | EUR    | 4 500 000           | 4 496 023,08            | 0,05         |
| SSE ZCP 11-12-25                                             | EUR    | 13 000 000          | 12 945 414,22           | 0,16         |
| TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE 231025 FI                     | EUR    | 10 500 000          | 10 486 064,84           | 0,12         |
| <b>Logiciels</b>                                             |        |                     | <b>5 990 685,68</b>     | <b>0,07</b>  |
| EVONIK INDUSTRIES 271025 FIX 0.0                             | EUR    | 6 000 000           | 5 990 685,68            | 0,07         |
| <b>Marchés de capitaux</b>                                   |        |                     | <b>16 889 151,48</b>    | <b>0,20</b>  |
| ENEL FINA AMER LLC ZCP 19-12-25                              | USD    | 20 000 000          | 16 889 151,48           | 0,20         |
| <b>Outils et services appliqués aux sciences biologiques</b> |        |                     | <b>12 983 629,27</b>    | <b>0,15</b>  |
| DANAHER CORP 221025 FIX 0.0                                  | EUR    | 13 000 000          | 12 983 629,27           | 0,15         |
| <b>Services clientèle divers</b>                             |        |                     | <b>86 957 114,45</b>    | <b>1,03</b>  |
| ECOLAB NL 11 BV 011025 FIX 0.0                               | EUR    | 25 000 000          | 25 000 000,00           | 0,29         |
| ECOLAB NL 11 BV ZCP 01-10-25                                 | EUR    | 25 000 000          | 25 000 000,00           | 0,30         |
| ISS GLOBAL AS 101025 FIX 0.0                                 | EUR    | 4 000 000           | 3 997 828,88            | 0,05         |
| ISS GLOBAL AS 271025 FIX 0.0                                 | EUR    | 5 000 000           | 4 992 166,07            | 0,06         |
| ISS GLOBAL AS 311025 FIX 0.0                                 | EUR    | 14 500 000          | 14 473 769,91           | 0,17         |
| ITT INDU LUXE SARL ZCP 02-10-25                              | EUR    | 3 000 000           | 2 999 797,43            | 0,04         |
| ITT INDU LUXE SARL ZCP 09-10-25                              | EUR    | 4 000 000           | 3 997 839,30            | 0,05         |
| ITT INDUSTRIES LUXEMBOURG SARL 081025 FI                     | EUR    | 4 500 000           | 4 497 873,01            | 0,05         |
| ITT INDUSTRIES LUXEMBOURG SARL 171025 FI                     | EUR    | 2 000 000           | 1 997 839,85            | 0,02         |
| <b>Services de télécommunication diversifiés</b>             |        |                     | <b>69 907 040,61</b>    | <b>0,83</b>  |
| TELEFONICA EUROPE BV 020126 FIX 0.0                          | EUR    | 25 000 000          | 24 860 252,24           | 0,30         |
| TELSTRA GROUP LTD 181225 FIX 0.0                             | USD    | 21 250 000          | 17 946 527,71           | 0,21         |
| TELUS CORP 131125 FIX 0.0                                    | USD    | 15 000 000          | 12 713 827,38           | 0,15         |
| TELUS CORP 251125 FIX 0.0                                    | USD    | 17 000 000          | 14 386 433,28           | 0,17         |
| <b>Services de télécommunication mobile</b>                  |        |                     | <b>4 993 100,59</b>     | <b>0,06</b>  |
| AMERICA MOVIL BV 241025 FIX 0.0                              | EUR    | 5 000 000           | 4 993 100,59            | 0,06         |
| <b>Services financiers diversifiés</b>                       |        |                     | <b>41 400 876,52</b>    | <b>0,49</b>  |
| AMCOR UK FINANCE PLC 221025 FIX 0.0                          | EUR    | 11 000 000          | 10 986 147,84           | 0,13         |
| ASSA ABLO FINA SER ZCP 14-11-25                              | EUR    | 8 000 000           | 7 979 199,20            | 0,09         |
| SGS NEDERLAND HOLDING BV 151225 FIX 0.0                      | EUR    | 9 000 000           | 8 957 062,08            | 0,11         |
| SUMI ELEC FINA UK ZCP 27-10-25                               | EUR    | 13 500 000          | 13 478 467,40           | 0,16         |
| <b>TITRES D'OPC</b>                                          |        |                     | <b>322 742 246,76</b>   | <b>3,83</b>  |
| <b>OPCVM</b>                                                 |        |                     | <b>322 742 246,76</b>   | <b>3,83</b>  |
| <b>Gestion collective</b>                                    |        |                     | <b>322 742 246,76</b>   | <b>3,83</b>  |
| OSTRUM EURO LIQUIDITY LVNAV Part SI                          | EUR    | 1 284               | 322 742 246,76          | 3,83         |
| <b>Total</b>                                                 |        |                     | <b>8 086 389 061,17</b> | <b>95,95</b> |

(\*) Le secteur d'activité représente l'activité principale de l'émetteur de l'instrument financier ; il est issu de sources fiables reconnues au plan international (GICS et NACE principalement).



## Inventaire des opérations à terme de devises

| Type d'opération   | Valeur actuelle présentée au bilan |                      | Montant de l'exposition (*) |                       |                      |                        |
|--------------------|------------------------------------|----------------------|-----------------------------|-----------------------|----------------------|------------------------|
|                    | Actif                              | Passif               | Devises à recevoir (+)      |                       | Devises à livrer (-) |                        |
|                    |                                    |                      | Devise                      | Montant (*)           | Devise               | Montant (*)            |
| A/EUR/USD/20251126 | 0,00                               | -286 343,18          | EUR                         | 39 951 377,41         | USD                  | -40 237 720,59         |
| A/EUR/USD/20260303 | 42 660,43                          | 0,00                 | EUR                         | 8 632 974,36          | USD                  | -8 590 313,93          |
| V/SEK/EUR/20251021 | 0,00                               | -344 361,33          | EUR                         | 13 219 864,49         | SEK                  | -13 564 225,82         |
| V/SEK/EUR/20251216 | 90 631,05                          | 0,00                 | EUR                         | 10 461 121,30         | SEK                  | -10 370 490,25         |
| V/SEK/EUR/20251223 | 0,00                               | -38 807,05           | EUR                         | 31 512 545,26         | SEK                  | -31 551 352,31         |
| V/USD/EUR/20251017 | 36 569,01                          | 0,00                 | EUR                         | 9 608 912,68          | USD                  | -9 572 343,67          |
| V/USD/EUR/20251113 | 0,00                               | -20 058,46           | EUR                         | 12 704 874,18         | USD                  | -12 724 932,64         |
| V/USD/EUR/20251114 | 70 442,13                          | 0,00                 | EUR                         | 11 945 729,21         | USD                  | -11 875 287,08         |
| V/USD/EUR/20251125 | 317 410,61                         | 0,00                 | EUR                         | 14 719 868,15         | USD                  | -14 402 457,54         |
| V/USD/EUR/20251212 | 0,00                               | -174 885,27          | EUR                         | 25 192 005,24         | USD                  | -25 366 890,51         |
| V/USD/EUR/20251218 | 0,00                               | -162 617,74          | EUR                         | 17 793 034,18         | USD                  | -17 955 651,92         |
| V/USD/EUR/20251219 | 0,00                               | -67 090,58           | EUR                         | 16 830 370,27         | USD                  | -16 897 460,85         |
| V/USD/EUR/20260116 | 6 068,40                           | 0,00                 | EUR                         | 5 480 922,39          | USD                  | -5 474 853,99          |
| V/USD/EUR/20260123 | 111 391,71                         | 0,00                 | EUR                         | 14 840 819,81         | USD                  | -14 729 428,10         |
| <b>Total</b>       | <b>675 173,34</b>                  | <b>-1 094 163,61</b> |                             | <b>232 894 418,93</b> |                      | <b>-233 313 409,20</b> |

(\*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions exprimé dans la devise de comptabilisation.

**Inventaire des instruments financiers à terme****Inventaire des instruments financiers à terme - actions**

| Nature d'engagements         | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |             | Montant de l'exposition (*) |
|------------------------------|---------------------|------------------------------------|-------------|-----------------------------|
|                              |                     | Actif                              | Passif      | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |             |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     | <b>0,00</b>                        | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>                 |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |             |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     | <b>0,00</b>                        | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>                 |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |             |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     | <b>0,00</b>                        | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>                 |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |             |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     | <b>0,00</b>                        | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>                 |
| <b>Total</b>                 |                     | <b>0,00</b>                        | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>                 |

(\*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.



## Inventaire des instruments financiers à terme - taux d'intérêts

| Nature d'engagements | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |             | Montant de l'exposition (*) |
|----------------------|---------------------|------------------------------------|-------------|-----------------------------|
|                      |                     | Actif                              | Passif      | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>    |                     |                                    |             |                             |
| <b>Sous-total 1.</b> |                     | <b>0,00</b>                        | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>                 |
| <b>2. Options</b>    |                     |                                    |             |                             |
| <b>Sous-total 2.</b> |                     | <b>0,00</b>                        | <b>0,00</b> | <b>0,00</b>                 |
| <b>3. Swaps</b>      |                     |                                    |             |                             |
| FIX/1.9163/OISEST/0. | 75 000 000          | 0,00                               | -2 469,52   | 75 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.808 | 3 500 000           | 2 556,90                           | 0,00        | 3 500 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/1.809 | 10 000 000          | 6 223,20                           | 0,00        | 10 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.812 | 20 000 000          | 13 851,18                          | 0,00        | 20 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.815 | 10 000 000          | 6 772,81                           | 0,00        | 10 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.815 | 9 000 000           | 6 142,94                           | 0,00        | 9 000 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/1.816 | 12 500 000          | 7 517,50                           | 0,00        | 12 500 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.823 | 20 000 000          | 12 625,30                          | 0,00        | 20 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.824 | 7 500 000           | 4 306,56                           | 0,00        | 7 500 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/1.825 | 11 500 000          | 6 544,94                           | 0,00        | 11 500 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.833 | 7 000 000           | 3 504,78                           | 0,00        | 7 000 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/1.834 | 25 000 000          | 12 328,29                          | 0,00        | 25 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.838 | 25 000 000          | 12 016,64                          | 0,00        | 25 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.838 | 20 000 000          | 9 484,33                           | 0,00        | 20 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.846 | 17 400 000          | 9 502,92                           | 0,00        | 17 400 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.846 | 9 000 000           | 4 062,10                           | 0,00        | 9 000 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/1.850 | 17 000 000          | 8 027,54                           | 0,00        | 17 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.853 | 10 000 000          | 3 362,46                           | 0,00        | 10 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.854 | 15 000 000          | 6 032,18                           | 0,00        | 15 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.856 | 11 000 000          | 3 887,79                           | 0,00        | 11 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.861 | 14 000 000          | 8 685,85                           | 0,00        | 14 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.863 | 150 000 000         | 52 416,16                          | 0,00        | 150 000 000,00              |
| OISEST/0.0/FIX/1.864 | 38 000 000          | 13 110,84                          | 0,00        | 38 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.864 | 150 000 000         | 88 978,00                          | 0,00        | 150 000 000,00              |
| OISEST/0.0/FIX/1.864 | 70 000 000          | 41 523,07                          | 0,00        | 70 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.865 | 25 000 000          | 11 560,11                          | 0,00        | 25 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.866 | 8 000 000           | 4 585,28                           | 0,00        | 8 000 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/1.867 | 10 000 000          | 5 711,46                           | 0,00        | 10 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.869 | 24 000 000          | 6 429,84                           | 0,00        | 24 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.870 | 25 000 000          | 15 086,22                          | 0,00        | 25 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.872 | 20 000 000          | 10 262,62                          | 0,00        | 20 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.872 | 4 000 000           | 2 187,08                           | 0,00        | 4 000 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/1.875 | 4 000 000           | 1 607,40                           | 0,00        | 4 000 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/1.875 | 7 000 000           | 3 714,23                           | 0,00        | 7 000 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/1.876 | 75 000 000          | 32 756,00                          | 0,00        | 75 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.879 | 5 000 000           | 1 792,23                           | 0,00        | 5 000 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/1.879 | 18 100 000          | 2 504,64                           | 0,00        | 18 100 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.881 | 4 000 000           | 902,46                             | 0,00        | 4 000 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/1.881 | 75 000 000          | 41 634,42                          | 0,00        | 75 000 000,00               |



## Inventaire des instruments financiers à terme - taux d'intérêts

| Nature d'engagements         | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |                   | Montant de l'exposition (*) |
|------------------------------|---------------------|------------------------------------|-------------------|-----------------------------|
|                              |                     | Actif                              | Passif            | +/-                         |
| OISEST/0.0/FIX/1.883         | 75 000 000          | 41 728,50                          | 0,00              | 75 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.889         | 9 000 000           | 1 485,40                           | 0,00              | 9 000 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/1.890         | 14 000 000          | 2 465,54                           | 0,00              | 14 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.892         | 4 500 000           | 1 517,61                           | 0,00              | 4 500 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/1.905         | 50 000 000          | 2 585,85                           | 0,00              | 50 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.906         | 40 000 000          | 18 477,50                          | 0,00              | 40 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.907         | 7 000 000           | 362,26                             | 0,00              | 7 000 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/1.908         | 10 500 000          | 4 485,74                           | 0,00              | 10 500 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.909         | 35 000 000          | 1 693,21                           | 0,00              | 35 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.917         | 20 000 000          | 0,00                               | -111,28           | 20 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.917         | 25 000 000          | 4,31                               | 0,00              | 25 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.918         | 15 000 000          | 4 057,33                           | 0,00              | 15 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.918         | 25 000 000          | 0,00                               | -214,79           | 25 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.920         | 75 000 000          | 0,00                               | -1 554,79         | 75 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.922         | 8 000 000           | 1 963,73                           | 0,00              | 8 000 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/1.932         | 5 000 000           | 959,28                             | 0,00              | 5 000 000,00                |
| OISEST/0.0/FIX/1.961         | 100 000 000         | 35 912,61                          | 0,00              | 100 000 000,00              |
| OISEST/0.0/FIX/1.971         | 10 000 000          | 1 418,53                           | 0,00              | 10 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.987         | 80 000 000          | 13 834,98                          | 0,00              | 80 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.988         | 70 000 000          | 10 759,93                          | 0,00              | 70 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.993         | 50 000 000          | 6 302,33                           | 0,00              | 50 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.994         | 50 000 000          | 6 019,00                           | 0,00              | 50 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/1.995         | 100 000 000         | 11 571,33                          | 0,00              | 100 000 000,00              |
| OISEST/0.0/FIX/2.035         | 50 000 000          | 1 036,22                           | 0,00              | 50 000 000,00               |
| OISEST/0.0/FIX/2.117         | 100 000 000         | 0,00                               | -32 949,31        | 100 000 000,00              |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     | <b>652 839,46</b>                  | <b>-37 299,69</b> | <b>2 089 500 000,00</b>     |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |                   |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     | <b>0,00</b>                        | <b>0,00</b>       | <b>0,00</b>                 |
| <b>Total</b>                 |                     | <b>652 839,46</b>                  | <b>-37 299,69</b> | <b>2 089 500 000,00</b>     |

(\*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

**Inventaire des instruments financiers à terme - de change**

| Nature d'engagements         | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|------------------------------|---------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
|                              |                     | Actif                              | Passif | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| <b>Total</b>                 |                     | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |

(\*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

**Inventaire des instruments financiers à terme - sur risque de crédit**

| Nature d'engagements         | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|------------------------------|---------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
|                              |                     | Actif                              | Passif | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| <b>Total</b>                 |                     | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |

(\*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

**Inventaire des instruments financiers à terme - autres expositions**

| Nature d'engagements         | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle présentée au bilan |        | Montant de l'exposition (*) |
|------------------------------|---------------------|------------------------------------|--------|-----------------------------|
|                              |                     | Actif                              | Passif | +/-                         |
| <b>1. Futures</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 1.</b>         |                     | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| <b>2. Options</b>            |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 2.</b>         |                     | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| <b>3. Swaps</b>              |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 3.</b>         |                     | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| <b>4. Autres instruments</b> |                     |                                    |        |                             |
| <b>Sous-total 4.</b>         |                     | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |
| <b>Total</b>                 |                     | 0,00                               | 0,00   | 0,00                        |

(\*) Montant déterminé selon les dispositions du règlement relatif à la présentation des expositions.

**Inventaire des instruments financiers à terme ou des opérations à terme de devises utilisés en couverture d'une catégorie de part**

L'OPC sous revue n'est pas concerné par cette rubrique.



## Synthèse de l'inventaire

|                                                                                      | Valeur actuelle présentée au bilan |
|--------------------------------------------------------------------------------------|------------------------------------|
| Total inventaire des actifs et passifs éligibles (hors IFT)                          | 8 086 389 061,17                   |
| Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :               |                                    |
| Total opérations à terme de devises                                                  | -418 990,27                        |
| Total instruments financiers à terme - actions                                       | 0,00                               |
| Total instruments financiers à terme - taux                                          | 615 539,77                         |
| Total instruments financiers à terme - change                                        | 0,00                               |
| Total instruments financiers à terme - crédit                                        | 0,00                               |
| Total instruments financiers à terme - autres expositions                            | 0,00                               |
| Inventaire des instruments financiers à terme utilisés en couverture de parts émises | 0,00                               |
| Autres actifs (+)                                                                    | 343 797 715,38                     |
| Autres passifs (-)                                                                   | -2 359 915,74                      |
| Passifs de financement (-)                                                           | 0,00                               |
| <b>Total = actif net</b>                                                             | <b>8 428 023 410,31</b>            |

| Libellé de la part         | Devise de la part | Nombre de parts | Valeur liquidative |
|----------------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| Part OSTRUM SRI CASH C-NPF | EUR               | 3 562 995,58604 | 326,308            |
| Part OSTRUM SRI CASH D-NPF | EUR               | 133 335,08097   | 223,968            |
| Part OSTRUM SRI CASH E     | EUR               | 5 142,78447     | 7 564,20           |
| Part OSTRUM SRI CASH I     | EUR               | 278 040,31842   | 11 738,73          |
| Part OSTRUM SRI CASH M     | EUR               | 256 300,05996   | 10 733,59          |
| Part OSTRUM SRI CASH N     | EUR               | 1,00000         | 107,65             |
| Part OSTRUM SRI CASH P     | EUR               | 262 159,58510   | 3 460,65           |
| Part OSTRUM SRI CASH R     | EUR               | 104 055,10924   | 107,02             |
| Part OSTRUM SRI CASH T     | EUR               | 147,08926       | 3 406,94           |
| Part OSTRUM SRI CASH Z     | EUR               | 20 393,00000    | 10 708,28          |
| Part OSTRUM SRI CASH Z2    | EUR               | 4 153,96796     | 10 713,75          |



**NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL**

43 avenue Pierre Mendès France - CS 41432 - 75648 Paris cedex 13 France - Tél. : +33 (0)1 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