



NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

OPCVM de droit français

OSTRUM SRI CASH

RAPPORT SEMESTRIEL

au 30 septembre 2024

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	9 073 831 265,65
b) Avoirs bancaires	861 746 070,23
c) Autres actifs détenus par l'OPC	339 972 399,01
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	10 275 549 734,89
e) Passif	-5 738 603,67
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	10 269 811 131,22

(*) 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 E en EUR	C	56 587 692,42	7 665,09055	7 382,52
OSTRUM SRI CASH M en EUR	C / D	3 492 145 789,58	333 888,07849	10 459,03
OSTRUM SRI CASH Part C-NPF en EUR	C	1 213 711 182,94	3 811 058,49161	318,470
OSTRUM SRI CASH Part D-NPF en EUR	C / D	32 868 680,31	150 367,50735	218,588
OSTRUM SRI CASH Part G1 en EUR	C	74 910,41	71,00000	1 055,07
OSTRUM SRI CASH Part I en EUR	C	4 497 716 809,81	393 163,25097	11 439,81
OSTRUM SRI CASH PART N en EUR	C	104,42	1,00000	104,42
OSTRUM SRI CASH Part P en EUR	C	885 687 057,77	262 228,83882	3 377,53
OSTRUM SRI CASH PART R en EUR	C	1 430 972,75	13 701,00000	104,44
OSTRUM SRI CASH Part T en EUR	C	451 968,27	135,92564	3 325,11
OSTRUM SRI CASH Part Z en EUR	C / D	54 222 435,74	5 196,00000	10 435,41
OSTRUM SRI CASH Part Z2 en EUR	C / D	34 913 526,80	3 343,96796	10 440,74



ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Eléments du portefeuille titres	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
A) Les titres financiers éligibles et les instruments du marché monétaire admis à la négociation sur un marché réglementé au sens de l'article L. 422-1 du code monétaire et financier.	76,70	76,66
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.	11,41	11,40
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.	3,51	3,51

(*) 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	8 884 555 502,87	86,51	86,46
Dollar Us	USD	138 264 215,48	1,35	1,35
Couronne Suédoise	SEK	25 604 327,17	0,25	0,25
TOTAL		9 048 424 045,52	88,11	88,06

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

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

**RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR PAYS DE RÉSIDENCE DE L'ÉMETTEUR**

Pays	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
FRANCE	51,60	51,57
LUXEMBOURG	8,65	8,64
PAYS-BAS	8,59	8,58
ROYAUME-UNI	5,48	5,48
ITALIE	4,10	4,10
ESPAGNE	3,92	3,92
BELGIQUE	2,08	2,08
ALLEMAGNE	0,90	0,90
ETATS-UNIS	0,78	0,78
AUSTRALIE	0,77	0,77
IRLANDE	0,34	0,34
SUEDE	0,25	0,25
DANEMARK	0,25	0,25
SUISSE	0,20	0,20
PORTUGAL	0,19	0,19
TOTAL	88,11	88,06

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

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

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

Nature d'actifs	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	3,26	3,26
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	0,25	0,25
TOTAL	3,51	3,51

(*) 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.	13 217 775 371,01	15 186 399 635,60
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.	2 233 330 095,60	2 328 552 202,47
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.	112 375 705,08	70 007 550,46

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

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

	30/09/2024
Part OSTRUM SRI CASH E	
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
Part OSTRUM SRI CASH M	
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
Part OSTRUM SRI CASH Part C-NPF	
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
Part OSTRUM SRI CASH Part D-NPF	
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
Part OSTRUM SRI CASH Part G1	
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
Part OSTRUM SRI CASH Part I	
Frais de gestion variables provisionnés	91 346,55
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. »



30/09/2024

Part OSTRUM SRI CASH PART N	
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
Part OSTRUM SRI CASH Part P	
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
Part OSTRUM SRI CASH PART R	
Frais de gestion variables provisionnés	5,63
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
Part OSTRUM SRI CASH Part T	
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
Part OSTRUM SRI CASH Part Z	
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
Part OSTRUM SRI CASH Part Z2	
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
OBLIGATIONS ET VALEURS ASSIMILÉES			701 285 266,31	6,83
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé			675 878 046,18	6,58
Services aux professionnels			11 114 311,64	0,11
BUREAU VERITAS 1.875% 06-01-25	EUR	11 000 000	11 114 311,64	0,11
Services financiers diversifiés			664 763 734,54	6,47
CODEIS SECURITIES OISEST+0.05% 05-02-25	EUR	100 000 000	102 583 126,67	1,00
CODEIS SECURITIES OISEST+0.07% 02-05-25	EUR	250 000 000	254 040 326,25	2,48
PURPLE PROTECTED ASSET OISEST+0.05% 18-10-24	EUR	225 000 000	233 613 500,00	2,27
PURPLE PROTECTED ASSET OISEST+0.05% 18-11-24	EUR	30 000 000	31 046 154,67	0,30
PURPLE PROTECTED ASSET OISEST+0.08% 17-12-24	EUR	42 000 000	43 480 626,95	0,42
Obligations et valeurs assimilées non négociées sur un marché réglementé ou assimilé			25 407 220,13	0,25
Services financiers diversifiés			25 407 220,13	0,25
PURPLE PROTECTED ASSET OISEST+0.1% 02-05-25	EUR	25 000 000	25 407 220,13	0,25
TITRES DE CRÉANCES			8 372 545 999,34	81,53
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé			8 132 509 499,62	79,19
Assurance			30 546 656,56	0,30
AXA SA 190325 FIX 0.0	EUR	31 000 000	30 546 656,56	0,30
Automobiles			21 980 606,99	0,21
General Motors Financial Co Inc 070225 F	USD	25 000 000	21 980 606,99	0,21
Banques commerciales			3 579 305 872,48	34,85
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 19032	EUR	100 000 000	98 536 279,96	0,96
BANQUE PALATINE 111024 OISEST 0.18	EUR	20 000 000	20 380 145,84	0,20
BNP PA OISEST+0.145% 14-10-24	EUR	200 000 000	203 744 113,11	1,95
BNP PARIBAS 120225 OISEST 0.17	EUR	100 000 000	100 531 681,94	0,98
BNP PARIBAS 200325 OISEST 0.16	EUR	50 000 000	50 052 584,56	0,49
BNP PARIBAS 280225 OISEST 0.17	EUR	50 000 000	50 167 726,00	0,49
BNP PAR SECU SERV ZCP 28-11-24	EUR	75 000 000	74 596 257,70	0,73
BPCE SA 100325 OISEST 0.18	EUR	100 000 000	100 238 406,22	0,98
BPCE SA 141124 OISEST 0.18	EUR	200 000 000	203 064 026,67	1,98
BPCE SA 151024 OISEST 0.17	EUR	30 000 000	30 555 398,24	0,30
CFCM MAINE ANJOU B 041024 OISEST 0.19	EUR	20 000 000	20 396 743,00	0,20
CFCM MAINE ANJOU B 050325 OISEST 0.19	EUR	20 000 000	20 057 883,28	0,20
CFCM MAINE ANJOU B 051224 OISEST 0.19	EUR	10 000 000	10 128 906,31	0,10
CFCM MAINE ANJOU B 091224 OISEST 0.19	EUR	30 000 000	30 379 774,33	0,30
CFCM MAINE ANJOU B 251124 OISEST 0.19	EUR	10 000 000	10 142 602,78	0,10
CFCM MAINE ANJOU B 260325 OISEST 0.19	EUR	20 000 000	20 013 817,92	0,19
CFCM MAINE ANJOU BA 170125 OISEST 0.195	EUR	40 000 000	40 332 581,16	0,39
CFCM MAINE ANJOU BA 220125 OISEST 0.195	EUR	20 000 000	20 155 620,13	0,20
CFCM MAINE ANJOU BASSE NORMANDIE 050225 OISEST 0.2	EUR	30 000 000	30 189 074,25	0,29
CFCM MAINE ANJOU BASSE NORMANDIE 151124	EUR	30 000 000	30 456 199,25	0,30



Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
CRCA A OISEST+0.17% 11-10-24	EUR	20 000 000	20 379 064,73	0,20
CRCAM TOULOUSE 31 090125 OISEST 0.19	EUR	10 000 000	10 089 276,75	0,10
CRCAM TOULOUSE 31 090125 OISEST 0.2	EUR	20 000 000	20 179 569,06	0,20
CREDIT AGRICOLE SA 020125 OISEST 0.175	EUR	100 000 000	100 978 785,03	0,98
CREDIT AGRICOLE SA 150125 OISEST 0.2	EUR	100 000 000	100 852 418,50	0,98
CREDIT AGRICOLE SA 260225 OISEST 0.18	EUR	75 000 000	75 290 923,50	0,73
CREDIT MUTUEL ARKEA 041024 OISEST 0.16	EUR	25 000 000	25 492 028,75	0,25
CREDIT MUTUEL ARKEA 071124 OISEST 0.16	EUR	25 000 000	25 400 150,52	0,25
CREDIT MUTUEL ARKEA 080125 OISEST 0.14	EUR	100 000 000	100 902 221,25	0,98
CREDIT MUTUEL ARKEA 111024 OISEST 0.16	EUR	30 000 000	30 567 065,43	0,30
ING BANK NEDERLAND NV 030225 OISEST 0.16	EUR	80 000 000	80 521 804,00	0,78
ING BANK NEDERLAND NV 040325 OISEST 0.16	EUR	50 000 000	50 146 147,75	0,49
ING BANK NEDERLAND NV 251024 FIX 0.0	EUR	75 000 000	74 833 395,92	0,73
ING BANK NEDERLAND NV 280225 OISEST 0.16	EUR	100 000 000	100 369 650,33	0,98
ING BA OISEST+0.15% 07-10-24	EUR	50 000 000	50 976 815,21	0,50
INTE BANK IREL ZCP 17-10-24	EUR	15 000 000	14 977 199,38	0,15
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG 221124 FIX 0.0	EUR	70 000 000	69 663 009,06	0,68
KBC GROUPE ZCP 23-12-24	EUR	11 000 000	10 912 533,17	0,11
LA BANQUE POSTALE 090125 OISEST 0.15	EUR	100 000 000	100 905 482,36	0,98
LA BANQUE POSTALE 130325 OISEST 0.16	EUR	100 000 000	100 186 521,00	0,98
LA BANQUE POSTALE 151024 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 933 520,45	0,49
LA BANQUE POSTALE 240125 OISEST 0.165	EUR	100 000 000	100 733 259,22	0,98
LA BANQUE POSTALE 270325 OISEST 0.17	EUR	100 000 000	100 044 736,00	0,97
LCL CREDIT LYONNAIS 030125 OISEST 0.18	EUR	50 000 000	50 485 292,50	0,49
LCL CREDIT LYONNAIS 060125 OISEST 0.18	EUR	50 000 000	50 474 626,00	0,49
LCL CREDIT LYONNAIS 060225 OISEST 0.19	EUR	100 000 000	100 610 701,33	0,98
LCL CREDIT LYONNAIS 100325 OISEST 0.19	EUR	50 000 000	50 118 808,67	0,49
LCL CREDIT LYONNAIS 190325 OISEST 0.19	EUR	75 000 000	75 094 580,00	0,73
LCL CREDIT LYONNAIS 281124 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 729 778,61	0,48
MUFG BANK, LTD., LONDON BRANCH 170325 FI	EUR	100 000 000	98 553 757,01	0,96
MUFG BANK, LTD., LONDON BRANCH 240325 FI	EUR	100 000 000	98 503 427,57	0,96
RCI BANQUE SA 060225 FIX 0.0	EUR	16 500 000	16 310 576,93	0,16
RCI BANQUE SA 120325 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 565 266,41	0,29
RCI BANQUE SA 240325 FIX 0.0	EUR	43 000 000	42 332 308,72	0,41
RCI BANQUE SA 260225 FIX 0.0	EUR	14 000 000	13 814 205,84	0,13
SOCIETE GENERALE 021224 FIX 0.0	EUR	100 000 000	99 427 624,99	0,97
SOCIETE GENERALE 021224 OISEST 0.14	EUR	50 000 000	50 415 609,25	0,49
SOCIETE GENERALE 021224 OISEST 0.17	EUR	100 000 000	101 068 314,25	0,98
UNICREDIT S.P.A. 060125 FIX 0.0	EUR	75 000 000	74 345 594,38	0,72
Biens de consommation durables			19 969 190,02	0,19
SEB SA 041024 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 998 519,23	0,05
SEB SA 211024 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 970 670,79	0,14



Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Boissons			40 349 450,88	0,39
CARLSBERG BREWERIES A/S 061124 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 978 800,97	0,06
CARLSBERG BREWERIES A/S 131124 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 979 010,72	0,05
CARLSBERG BREWERIES A/S 161024 FIX 0.0	EUR	9 500 000	9 485 694,78	0,09
PERNOD RICARD 201124 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 905 944,41	0,19
Composants automobiles			170 579 987,40	1,66
BRID EURO 041124 FIX 0.0	EUR	8 000 000	7 974 335,53	0,08
CONTINENTAL AG 271124 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 865 796,60	0,24
CONTINENTAL AG 291124 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 722 608,62	0,49
OPMOBILITY 031024 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 999 157,58	0,04
OPMOBILITY 041224 FIX 0.0	EUR	8 500 000	8 444 336,44	0,08
OPMOBILITY 191224 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 943 553,63	0,07
OPMOBILITY 291124 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 963 748,53	0,06
VALEO SA 101224 FIX 0.0	EUR	3 500 000	3 476 321,42	0,03
VALEO SA 121124 FIX 0.0	EUR	7 500 000	7 469 143,72	0,07
VALEO SA 121224 FIX 0.0	EUR	21 000 000	20 853 963,86	0,20
VALEO SA 131124 FIX 0.0	EUR	18 000 000	17 924 225,39	0,17
VALEO SA 151124 FIX 0.0	EUR	13 000 000	12 942 796,08	0,13
Crédit à la consommation			85 555 933,41	0,83
NTT FINANCE UK LIMITED 051224 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 688 463,68	0,48
NTT FINANCE UK LIMITED 071124 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 982 007,95	0,05
NTT FINANCE UK LIMITED 081124 FIX 0.0	EUR	31 000 000	30 885 461,78	0,30
Distribution de produits alimentaires de première nécessité			147 329 204,11	1,43
CARREFOUR S A 220125 FIX 0.0	EUR	7 500 000	7 421 080,11	0,07
CARREFOUR S A 281024 FIX 0.0	EUR	12 500 000	12 467 038,40	0,12
CARREFOUR S A 291124 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 719 124,24	0,49
REN-REDES ENERGETICAS NACIONAI 021224 FI	EUR	20 000 000	19 879 210,49	0,19
SAVENCIA SA 131124 FIX 0.0	EUR	18 000 000	17 925 304,21	0,17
SAVENCIA SA 151024 FIX 0.0	EUR	13 000 000	12 981 959,04	0,13
SAVENCIA SA 311024 FIX 0.0	EUR	19 500 000	19 443 124,00	0,19
WORLDLINE SA 111024 FIX 0.0	EUR	7 500 000	7 492 363,62	0,07
Divertissement			44 949 206,48	0,44
VIVENDI 071024 FIX 0.0	EUR	17 000 000	16 989 894,69	0,17
VIVENDI 081024 FIX 0.0	EUR	17 000 000	16 988 211,31	0,16
VIVENDI 281024 FIX 0.0	EUR	11 000 000	10 971 100,48	0,11
Electricité			281 470 440,09	2,74
EDF 031024 FIX 0.0	EUR	150 000 000	149 970 518,30	1,45
EDF 281124 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 862 255,92	0,24
ORANO SA 081124 FIX 0.0	EUR	11 000 000	10 957 655,36	0,11
ORANO SA 111024 FIX 0.0	EUR	10 500 000	10 489 082,03	0,10
ORANO SA 131124 FIX 0.0	EUR	6 500 000	6 471 790,20	0,06
ORANO SA 291024 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 971 412,29	0,10
SSE PLC. 111224 FIX 0.0	EUR	13 000 000	12 911 529,02	0,13
SSE PLC. 130125 FIX 0.0	EUR	4 500 000	4 455 862,80	0,04
SSE PLC. 161024 FIX 0.0	EUR	8 000 000	7 987 986,73	0,08
SSE PLC. 211024 FIX 0.0	EUR	5 500 000	5 489 055,74	0,05



Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SSE PLC. 291024 FIX 0.0	EUR	8 000 000	7 977 934,19	0,08
SSE PLC. 291124 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 943 257,70	0,10
TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE 081024 FI	EUR	15 000 000	14 989 545,79	0,15
TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE 161024 FI	EUR	5 000 000	4 992 554,02	0,05
Emballage et conditionnement			13 918 042,82	0,14
VERALLIA SASU 081024 FIX 0.0	EUR	9 000 000	8 993 848,06	0,09
VERALLIA SASU 200325 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 924 194,76	0,05
Equipements électriques			4 641 434,00	0,05
NEXANS SA 200325 FIX 0.0	EUR	3 000 000	2 950 849,99	0,03
NEXANS SA 261124 FIX 0.0	EUR	1 700 000	1 690 584,01	0,02
Equipements et instruments électroniques			177 831 744,17	1,73
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 011024 FIX 0.	EUR	50 000 000	50 000 000,00	0,47
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 091224 FIX 0.	EUR	29 500 000	29 307 741,70	0,29
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 111124 FIX 0.	EUR	12 000 000	11 952 817,58	0,12
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 131224 FIX 0.	EUR	8 000 000	7 944 983,70	0,08
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 171224 FIX 0.	EUR	14 000 000	13 898 711,44	0,14
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 181224 FIX 0.	EUR	25 000 000	24 816 902,55	0,24
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 241024 FIX 0.0	EUR	40 000 000	39 910 587,20	0,39
FPI Bureautiques			79 720 559,88	0,78
GECINA 051124 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 933 469,28	0,19
GECINA 291024 FIX 0.0	EUR	35 000 000	34 906 304,88	0,35
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 181124 FIX 0.0	EUR	18 000 000	17 917 396,03	0,17
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 251124 FIX 0.	EUR	7 000 000	6 963 389,69	0,07
FPI de détail			25 793 364,63	0,25
CARMILA SA 091024 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 996 023,17	0,05
CARMILA SA 191124 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 971 792,45	0,06
KLEPIERRE 051224 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 970 267,93	0,05
KLEPIERRE 170325 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 855 281,08	0,09
FPI Hôtel et Lieu de Villégiature			9 985 961,79	0,10
COVIVIO HOTELS SCA 151024 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 985 961,79	0,10
FPI Soins de Santé			68 906 911,49	0,67
COFINIMMO SA 091024 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 992 101,80	0,10
COFINIMMO SA 141024 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 987 169,59	0,10
COFINIMMO SA 161024 FIX 0.0	EUR	49 000 000	48 927 640,10	0,47
Gaz			94 585 802,32	0,92
SNAM SPA 111024 FIX 0.0	EUR	33 000 000	32 967 195,81	0,32
SNAM SPA 151024 FIX 0.0	EUR	12 000 000	11 983 323,54	0,12
SNAM SPA 171224 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 635 282,97	0,48
Gestion et promotion immobilière			69 475 329,94	0,68
CDC HABITAT 061224 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 870 566,44	0,19
CDC HABITAT 080125 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 810 133,74	0,19
CDC HABITAT 101224 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 794 629,76	0,30
Hôtels, restaurants et loisirs			17 938 967,24	0,17
ACCOR SA 231024 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 989 038,45	0,05
ACCOR SA 241024 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 983 976,12	0,06
ACCOR SA 291124 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 965 952,67	0,06



Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Industrie aérospatiale et défense			5 961 737,86	0,06
HONEYWELL INTERNATIONAL INC 061224 FIX 0	EUR	6 000 000	5 961 737,86	0,06
Infrastructure de transports			4 679 878,71	0,05
ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA 141124 FIX 0	EUR	4 700 000	4 679 878,71	0,05
Logiciels			75 146 038,81	0,73
VINCI SA 011024 OISEST 0.145	EUR	22 500 000	22 717 952,83	0,22
VINCI SA 200125 OISEST 0.19	EUR	52 000 000	52 428 085,98	0,51
Marchés de capitaux			299 708 565,32	2,92
BANC SANT ALL SPAI ZCP 07-10-24	EUR	150 000 000	149 912 466,11	1,46
BANC SANT ALL SPAI ZCP 15-10-24	EUR	150 000 000	149 796 099,21	1,46
Médias			10 993 141,38	0,11
HAVAS SA 071024 FIX 0.0	EUR	11 000 000	10 993 141,38	0,11
Métaux et minerais			29 915 048,91	0,29
ARCELORMITTAL 291024 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 915 048,91	0,29
Pétrole et gaz			115 222 207,59	1,12
ENI SPA 161024 FIX 0.0	EUR	100 000 000	99 850 665,01	0,97
ENI SPA 271224 FIX 0.0	EUR	15 500 000	15 371 542,58	0,15
Produits alimentaires			37 439 042,99	0,36
BARRY CALLEBAUT SERVICES NV 081124 FIX 0	EUR	2 000 000	1 992 011,08	0,02
BARRY CALLEBAUT SERVICES NV 091224 FIX 0	EUR	2 500 000	2 482 121,69	0,02
BARRY CALLEBAUT SERVICES NV 141024 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 990 205,19	0,07
BARRY CALLEBAUT SERVICES NV 151024 FIX 0	EUR	9 500 000	9 485 701,15	0,10
BONDUELLE 011024 FIX 0.0	EUR	5 500 000	5 500 000,00	0,05
BONDUELLE 041024 FIX 0.0	EUR	7 500 000	7 497 650,80	0,07
BONDUELLE 251024 FIX 0.0	EUR	3 500 000	3 491 353,08	0,03
Produits chimiques			34 461 206,22	0,34
AKZO NOBEL NV 250325 FIX 0.0	EUR	35 000 000	34 461 206,22	0,34
Services aux collectivités			273 455 653,06	2,66
EDP FINANCE BV 021024 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 997 512,75	0,24
EDP FINANCE BV 291024 FIX 0.0	EUR	21 500 000	21 441 293,50	0,21
VEOLIA ENVIRONNEMENT 071024 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 970 869,48	0,49
VEOLIA ENVIRONNEMENT 200125 OISEST 0.165	EUR	15 000 000	15 119 160,51	0,15
VEOLIA ENVIRONNEMENT 240225 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 676 679,16	0,24
VEOLIA ENVIRONNEMENT 241024 OISEST 0.15	EUR	15 000 000	15 260 503,33	0,15
VEOLIA ENVIRONNEMENT 280225 OISEST 0.155	EUR	50 000 000	50 177 002,94	0,48
VEOLIA ENVIRONNEMENT 281024 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 871 287,19	0,49
VEOLIA ENVIRONNEMENT 291024 FIX 0.0	EUR	22 000 000	21 941 344,20	0,21
Services aux entreprises			46 146 132,07	0,45
ELIS SA EX HOLDELIS SA 131224 FIX 0.0	EUR	3 000 000	2 977 932,59	0,03
ELIS SA EX HOLDELIS SA 241024 FIX 0.0	EUR	4 500 000	4 489 334,36	0,04
LA POSTE 111224 FIX 0.0	EUR	17 500 000	17 385 805,01	0,17
LA POSTE 270125 FIX 0.0	EUR	17 500 000	17 315 608,78	0,17
SOCIETE BIC 271124 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 977 451,33	0,04



Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Services aux professionnels			24 384 697,17	0,24
TELEPERFORMANCE SE 041124 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 967 058,04	0,10
TELEPERFORMANCE SE 281124 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 977 558,81	0,04
TELEPERFORMANCE SE 291124 FIX 0.0	EUR	10 500 000	10 440 080,32	0,10
Services clientèle divers			16 954 016,29	0,17
ECOLAB INC 311024 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 985 211,78	0,05
EDENRED 281024 FIX 0.0	EUR	12 000 000	11 968 804,51	0,12
Services de télécommunication diversifiés			95 912 626,72	0,93
PROXIMUS SA 031024 FIX 0.0	EUR	27 500 000	27 494 474,22	0,27
TELEFONICA EUROPE BV 020125 FIX 0.0	EUR	22 000 000	21 812 532,37	0,21
TELSTRA CORPORATION LIMITED 101224 FIX 0	USD	30 000 000	26 582 429,56	0,26
TELSTRA GROUP LTD 071124 FIX 0.0	USD	22 500 000	20 023 190,57	0,19
Services de télécommunication mobile			21 302 061,42	0,21
AMERICA MOVIL BV 020125 FIX 0.0	EUR	21 500 000	21 302 061,42	0,21
Services financiers diversifiés			1 689 931 942,07	16,46
AMCOR LIMITED 161024 FIX 0.0	EUR	11 000 000	10 983 298,98	0,11
AMCOR UK FINANCE PLC 101024 FIX 0.0	EUR	22 000 000	21 979 904,32	0,21
AMERICAN HONDA FINANCE CORP 191224 FIX 0	USD	35 000 000	30 975 898,77	0,30
AVER DENN TREA MAN ZCP 24-10-24	EUR	11 000 000	10 974 641,93	0,11
BANQUE FEDERATIVE 091024 OISEST 0.18	EUR	75 000 000	76 442 498,44	0,74
BANQUE FEDERATIVE 241024 OISEST 0.18	EUR	170 000 000	172 986 427,78	1,66
CA CONSUMER FINANCE 250325 FIX 0.0	EUR	100 000 000	98 492 598,14	0,96
CA CONSUMER FINANCE 280225 OISEST 0.2	EUR	75 000 000	75 274 113,19	0,73
CA CONSUMER FINANCE 300125 OISEST 0.21	EUR	100 000 000	100 696 831,25	0,98
CASSA DEPOSITI E PRESTITI SPA 281024 FIX 0.0	EUR	100 000 000	99 744 887,49	0,97
COFACE S A 131124 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 898 873,99	0,24
COFACE SA 190325 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 704 284,61	0,19
CRH AMERICA FINANCE INC 151024 FIX 0.0	USD	7 500 000	6 695 468,49	0,07
CRH FINANCE DAC 271224 FIX 0.0	EUR	5 500 000	5 453 949,08	0,05
DH EUROPE FINANCE II SARL 071024 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 968 963,44	0,49
DH EUROPE FINANCE II SARL 081124 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 977 028,62	0,06
DH EUROPE FINANCE II SARL 201224 FIX 0.0	EUR	6 500 000	6 448 718,36	0,06
DH EUROPE FINANCE II SARL 201224 FIX 0.0	EUR	6 500 000	6 448 718,36	0,06
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 281024 FIX 0.0	EUR	9 000 000	8 976 032,65	0,09
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 281024 FIX 0.0	EUR	48 000 000	47 872 174,11	0,47
FERROVIAL SE 031024 FIX 0.0	EUR	11 500 000	11 497 759,47	0,11
FERROVIAL SE 051224 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 847 548,90	0,24
FERROVIAL SE 251024 FIX 0.0	EUR	4 600 000	4 589 406,12	0,04
FERROVIAL SE 311024 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 956 722,72	0,15
FISERV INC 141124 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 937 064,67	0,15
MEDIOBANCA INTERNATIONAL LTD 041124 FIX 0.0	EUR	50 000 000	49 846 213,63	0,49
NATIXIS 030325 OISEST 0.18	EUR	150 000 000	150 473 704,63	1,47
NATIXIS 221124 FIX 0.0	EUR	100 000 000	99 516 724,67	0,97
NATIXIS 251124 FIX 0.0	EUR	45 000 000	44 770 043,65	0,44
PR FINA SA PAUL RI ZCP 13-12-24	EUR	14 000 000	13 903 710,28	0,14



Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
PR FINA SA PAUL RI ZCP 24-03-25	EUR	25 000 000	24 619 023,48	0,24
RECKITT BENCKI 301024 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 982 820,91	0,06
RELX (INVESTMENTS) PLC 071024 FIX 0.0	EUR	9 000 000	8 994 567,73	0,09
RELX (INVESTMENTS) PLC 071024 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 995 774,90	0,07
RELX (INVESTMENTS) PLC 071024 FIX 0.0	EUR	14 000 000	13 991 549,80	0,14
RELX (INVESTMENTS) PLC 141024 FIX 0.0	EUR	5 500 000	5 492 810,55	0,05
RELX (INVESTMENTS) PLC 281024 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 986 658,69	0,05
RELX (INVESTMENTS) PLC 281024 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 959 976,08	0,15
SGS NEDERLAND HOLDING BV 081124 FIX 0.0	EUR	5 700 000	5 677 866,73	0,06
SOCIETE FINANCIERE AGACHE 120225 FIX 0.0	EUR	9 500 000	9 384 765,71	0,09
SOCIETE FINANCIERE AGACHE 200125 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 745 045,20	0,24
SOCIETE FINANCIERE AGACHE 301024 FIX 0.0	EUR	70 000 000	69 802 464,84	0,68
SUMI MITS BANK COR ZCP 28-02-25	EUR	100 000 000	98 679 341,48	0,96
THE TORO BANK LOND ZCP 29-11-24	EUR	60 000 000	59 680 738,06	0,58
VOLKSWAGEN FINANS SVERIGE AB 151024 FIX 0.0	SEK	40 000 000	3 545 450,32	0,03
VOLKSWAGEN FINANS SVERIGE AB 161224 FIX	SEK	100 000 000	8 816 023,52	0,09
VOLKSWAGEN FINANS SVERIGE AB 271124 FIX	SEK	150 000 000	13 242 853,33	0,13
Services liés aux technologies de l'information			149 209 847,40	1,45
THALES SERVICES SAS 121124 FIX 0.0	EUR	115 000 000	114 545 848,62	1,11
THALES SERVICES SAS 130125 FIX 0.0	EUR	35 000 000	34 663 998,78	0,34
Soins et autres services médicaux			17 956 664,58	0,17
FRESENIUS MEDICAL CARE AG 251024 FIX 0.0	EUR	9 000 000	8 978 332,29	0,08
FRESENIUS MEDICAL CARE AG 251024 FIX 0.0	EUR	9 000 000	8 978 332,29	0,09
Transport routier et ferroviaire			198 894 324,35	1,94
REGIE AUTONOME 291124 FIX 0.0	EUR	200 000 000	198 894 324,35	1,94
Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé			240 036 499,72	2,34
Boissons			4 982 334,14	0,05
CARLSBERG BREWERIES A/S 061124 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 982 334,14	0,05
Crédit à la consommation			25 439 980,30	0,25
NTT FINANCE UK LIMITED 251024 FIX 0.0	EUR	25 500 000	25 439 980,30	0,25
Services de télécommunication diversifiés			32 006 621,10	0,31
TELSTRA CORPORATION LIMITED 191224 FIX 0.0	USD	24 970 000	22 100 218,78	0,21
TELSTRA GROUP LTD 300125 FIX 0.0	USD	11 250 000	9 906 402,32	0,10
Services financiers diversifiés			160 641 344,87	1,56
AMCOR UK FINANCE PLC 251124 FIX 0.0	EUR	36 000 000	35 808 137,51	0,33
CRH FINANCE DAC 151124 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 933 830,06	0,15
DH EUROPE FINANCE II SARL 121124 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 978 904,46	0,05
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 271124 FIX	EUR	11 000 000	10 936 954,56	0,11
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 281124 FIX	EUR	33 000 000	32 807 401,95	0,32
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 291124 FIX	EUR	22 000 000	21 869 286,66	0,21
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 301024 FIX 0.0	EUR	14 500 000	14 458 629,04	0,14
RECKITT BENCKI 251024 FIX 0.0	EUR	12 000 000	11 971 388,38	0,12
RELX (INVESTMENTS) PLC 141024 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 994 771,31	0,04
SGS NEDERLAND HOLDING BV 130225 FIX 0.0	EUR	9 000 000	8 882 040,94	0,09



Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Transport routier et ferroviaire			16 966 219,31	0,17
FERROVIE DELLO STATO ITALIANE SPA 211024	EUR	17 000 000	16 966 219,31	0,17
TITRES D'OPC			335 250 923,34	3,26
OPCVM			335 250 923,34	3,26
Gestion collective			335 250 923,34	3,26
OSTRUM SRI CASH A1P1 Part IC	EUR	2 738,33	335 250 923,34	3,26
Total			9 409 082 188,99	91,62

(*) 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/20241219	658 996,81	0,00	EUR	22 764 659,75	USD	-22 105 662,94
V/SEK/EUR/20241015	0,00	-62 878,86	EUR	3 482 850,05	SEK	-3 545 728,91
V/SEK/EUR/20241127	0,00	-53 477,55	EUR	13 196 313,82	SEK	-13 249 791,37
V/SEK/EUR/20241216	0,00	-129 848,75	EUR	8 690 877,14	SEK	-8 820 725,89
V/USD/EUR/20241015	128 622,12	0,00	EUR	6 824 260,72	USD	-6 695 638,60
V/USD/EUR/20241107	418 076,89	0,00	EUR	20 444 250,78	USD	-20 026 173,89
V/USD/EUR/20241210	696 147,10	0,00	EUR	27 285 535,29	USD	-26 589 388,19
V/USD/EUR/20241219	138 365,02	0,00	EUR	31 123 475,27	USD	-30 985 110,25
V/USD/EUR/20250130	162 125,60	0,00	EUR	10 072 820,14	USD	-9 910 694,54
V/USD/EUR/20250207	41 471,22	0,00	EUR	22 044 083,09	USD	-22 002 611,87
Total	2 243 804,76	-246 205,16		165 929 126,05		-163 931 526,45

(*) 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	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		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 - taux d'intérêts

Nature d'engagements	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle présentée au bilan		Montant de l'exposition (*)
		Actif	Passif	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
FIX/3.4118/OISEST/0.	100 000 000	0,00	-238,22	100 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.081	100 000 000	0,00	-37 417,50	100 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.086	35 000 000	0,00	-13 965,29	35 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.142	100 000 000	0,00	-64 012,45	100 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.144	25 000 000	0,00	-16 264,23	25 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.145	43 000 000	0,00	-28 065,24	43 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.153	20 000 000	0,00	-11 270,00	20 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.153	31 000 000	0,00	-17 468,50	31 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.154	100 000 000	0,00	-56 666,67	100 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.155	5 000 000	0,00	-3 007,20	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.167	10 000 000	0,00	-5 563,54	10 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.172	100 000 000	0,00	-58 143,75	100 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.182	22 308 700	0,00	-2 740,44	22 308 700,00
OISEST/0.0/FIX/3.191	30 000 000	0,00	-15 670,33	30 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.208	17 500 000	0,00	-2 015,05	17 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.240	100 000 000	0,00	-37 121,33	100 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.242	14 000 000	0,00	-4 112,08	14 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.261	25 000 000	0,00	-7 888,98	25 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.272	9 500 000	0,00	-427,63	9 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.287	9 000 000	0,00	-1 354,44	9 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.294	16 500 000	0,00	-43,42	16 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.308	4 500 000	0,00	-1 237,03	4 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.310	10 187 089	0,00	-836,29	10 187 089,00
OISEST/0.0/FIX/3.321	15 500 000	0,00	-2 961,92	15 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.322	8 000 000	0,00	-791,83	8 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.323	5 500 000	0,00	-1 080,34	5 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.372	6 500 000	0,00	-1 635,35	6 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.379	25 000 000	0,00	-6 213,36	25 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.380	50 000 000	0,00	-7 744,76	50 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.382	14 000 000	0,00	-3 140,85	14 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.383	7 000 000	0,00	-780,99	7 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.385	3 000 000	0,00	-541,17	3 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.389	3 500 000	0,00	-500,26	3 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.391	21 000 000	0,00	-3 772,36	21 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.394	15 000 000	0,00	-1 159,72	15 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.394	50 000 000	0,00	-13 574,95	50 000 000,00



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/3.395	29 500 000	0,00	-4 221,09	29 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.398	17 500 000	0,00	-3 203,18	17 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.419	20 000 000	0,00	-3 149,45	20 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.423	11 000 000	0,00	-730,79	11 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.423	11 000 000	0,00	-664,79	11 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.425	6 000 000	0,00	-435,95	6 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.425	6 000 000	0,00	-435,95	6 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.425	11 000 000	0,00	-656,23	11 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.425	12 000 000	0,00	-717,14	12 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.427	4 500 000	0,00	-346,46	4 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.427	8 500 000	0,00	-1 253,28	8 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.427	3 500 000	0,00	-219,10	3 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.428	25 000 000	0,00	-1 683,11	25 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.428	11 000 000	0,00	-883,57	11 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.428	11 000 000	0,00	-801,68	11 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.428	50 000 000	0,00	-3 203,72	50 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.429	11 000 000	0,00	-838,34	11 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.430	10 000 000	0,00	-768,41	10 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.431	2 500 000	0,00	-199,40	2 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.431	50 000 000	0,00	-4 060,79	50 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.431	6 000 000	0,00	-278,23	6 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.433	4 000 000	0,00	-233,99	4 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.435	31 000 000	0,00	-1 504,50	31 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.452	200 000 000	0,00	-3 602,77	200 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.454	100 000 000	0,00	-1 848,61	100 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.472	5 000 000	0,00	-107,11	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.476	7 500 000	0,00	-100,56	7 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.476	13 000 000	0,00	-174,31	13 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.477	25 000 000	0,00	-13 167,76	25 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.478	7 500 000	0,00	-4 382,60	7 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.479	7 500 000	0,00	-152,44	7 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.480	5 000 000	62,01	0,00	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.481	18 000 000	0,00	-33,63	18 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.483	18 000 000	0,00	-148,88	18 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.485	6 500 000	0,00	-84,45	6 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.496	22 936 761	0,00	-6 552,70	22 936 761,00
OISEST/0.0/FIX/3.506	11 000 000	0,00	-114,58	11 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.518	35 000 000	0,00	-20 671,70	35 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.529	22 000 000	0,00	-9 528,37	22 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.530	21 500 000	0,00	-9 531,72	21 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.530	115 000 000	0,00	-7 910,09	115 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.532	20 000 000	0,00	-11 345,19	20 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.542	75 000 000	0,00	-43 064,33	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/3.555	18 000 000	0,00	-2 224,08	18 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.557	11 000 000	0,00	-4 932,40	11 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.560	6 000 000	0,00	-943,93	6 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.562	19 500 000	0,00	-1 063,29	19 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.567	70 000 000	0,00	-3 835,12	70 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.569	30 000 000	0,00	-1 497,87	30 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.576	5 000 000	0,00	-1 607,62	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.594	40 000 000	0,00	-1 769,53	40 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.599	5 000 000	0,00	-302,41	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.606	100 000 000	0,00	-1 289,19	100 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.617	10 000 000	0,00	-334,15	10 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.626	7 500 000	0,00	-215,85	7 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.626	60 000 000	0,00	-16 732,73	60 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.629	9 000 000	0,00	-67,12	9 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.630	70 000 000	0,00	-11 598,61	70 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.636	25 000 000	0,00	-7 416,50	25 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.636	20 000 000	0,00	-2 716,05	20 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.648	50 000 000	0,00	-3,95	50 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.666	75 000 000	6 927,81	0,00	75 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.668	100 000 000	14 490,66	0,00	100 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.675	22 000 000	1 620,42	0,00	22 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.679	12 500 000	1 095,36	0,00	12 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.680	50 000 000	4 162,00	0,00	50 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.686	50 000 000	19 118,96	0,00	50 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.687	150 000 000	56 760,21	0,00	150 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.694	9 000 000	2 829,08	0,00	9 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.699	300 000 000	57 459,08	0,00	300 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.701	150 000 000	52 355,00	0,00	150 000 000,00
Sous-total 3.		216 880,59	-650 988,82	3 713 432 550,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		216 880,59	-650 988,82	3 713 432 550,00

(*) 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	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		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	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		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	+/-
1. Futures				
Sous-total 1.		0,00	0,00	0,00
2. Options				
Sous-total 2.		0,00	0,00	0,00
3. Swaps				
Sous-total 3.		0,00	0,00	0,00
4. Autres instruments				
Sous-total 4.		0,00	0,00	0,00
Total		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)	9 409 082 188,99
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	1 997 599,60
Total instruments financiers à terme - actions	0,00
Total instruments financiers à terme - taux	-434 108,23
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 (+)	864 006 860,55
Autres passifs (-)	-4 841 409,69
Passifs de financement (-)	0,00
Total = actif net	10 269 811 131,22

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part OSTRUM SRI CASH E	EUR	7 665,09055	7 382,52
Part OSTRUM SRI CASH M	EUR	333 888,07849	10 459,03
Part OSTRUM SRI CASH Part C-NPF	EUR	3 811 058,49161	318,470
Part OSTRUM SRI CASH Part D-NPF	EUR	150 367,50735	218,588
Part OSTRUM SRI CASH Part G1	EUR	71,00000	1 055,07
Part OSTRUM SRI CASH Part I	EUR	393 163,25097	11 439,81
Part OSTRUM SRI CASH PART N	EUR	1,00000	104,42
Part OSTRUM SRI CASH Part P	EUR	262 228,83882	3 377,53
Part OSTRUM SRI CASH PART R	EUR	13 701,00000	104,44
Part OSTRUM SRI CASH Part T	EUR	135,92564	3 325,11
Part OSTRUM SRI CASH Part Z	EUR	5 196,00000	10 435,41
Part OSTRUM SRI CASH Part Z2	EUR	3 343,96796	10 440,74



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