



# NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

OPCVM de droit français

**OSTRUM SRI MONEY 6M**

**RAPPORT SEMESTRIEL**

au 31 mars 2026

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

**Dépositaire : Caceis Bank**

**Commissaire aux Comptes : Forvis Mazars**



## 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	2 574 945 937,71
b) Avoirs bancaires	34 165 857,33
c) Autres actifs détenus par l'OPC	431 910 330,29
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	3 041 022 125,33
e) Passif	-7 480 819,86
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	3 033 541 305,47

(\*) 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 MONEY 6M E en EUR	C	23 857 281,21	2 113,32971	11 288,95
OSTRUM SRI MONEY 6M I en EUR	C	699 648 673,36	61 048,62260	11 460,51
OSTRUM SRI MONEY 6M N en EUR	C	1 447 281,08	14 455,09487	100,12
OSTRUM SRI MONEY 6M R en EUR	C	830 480,40	7 924,51724	104,79
OSTRUM SRI MONEY 6M SI/C en EUR	C	2 307 757 589,42	9 011,99298	256 076,27



## ÉLÉMENTS DU PORTEFEUILLE TITRES

Éléments 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.	67,49	67,33
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.	17,39	17,35
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.	7,07	7,06

(\*) 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 DEVISE**

Titres	Devise	En montant (EUR)	Pourcentage actif net (*)	Pourcentage total des actifs (**)
Euro	EUR	2 557 664 814,33	84,31	84,11
Dollar Us	USD	17 281 123,38	0,57	0,57
<b>TOTAL</b>		<b>2 574 945 937,71</b>	<b>84,88</b>	<b>84,67</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 (*)	Pourcentage total des actifs (**)
FRANCE	35,30	35,21
PAYS-BAS	8,14	8,12
CANADA	6,23	6,21
LUXEMBOURG	5,51	5,50
ROYAUME-UNI	5,12	5,11
ALLEMAGNE	4,74	4,73
ETATS-UNIS	4,73	4,72
ESPAGNE	4,41	4,40
ITALIE	4,13	4,12
DANEMARK	1,41	1,40
BELGIQUE	1,36	1,36
PORTUGAL	0,63	0,63
FINLANDE	0,49	0,49
ILES CAIMANS	0,49	0,49
SUEDE	0,47	0,47
NORVEGE	0,44	0,44
IRLANDE	0,44	0,44
JAPON	0,39	0,38
SUISSE	0,33	0,33
AUSTRALIE	0,10	0,10
<b>TOTAL</b>	<b>84,88</b>	<b>84,67</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 (*)	Pourcentage total des actifs (**)
OPCVM et équivalents d'autres Etats membres de l'Union Européenne	7,07	7,06
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	0,00	0,00
<b>TOTAL</b>	<b>7,07</b>	<b>7,06</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.  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.	1 963 083 958,31	1 635 526 631,20
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.	428 429 065,60	524 667 010,56
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.	875 928 192,42	874 403 545,69

**INFORMATIONS DIVERSES**

**Etablissement dépositaire** : Caceis Bank - 89-91 rue Gabriel Péri - 92120 - Montrouge

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**

	31/03/2026
<b>Part OSTRUM SRI MONEY 6M 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 MONEY 6M I</b>	
Frais de gestion variables provisionnés	17 920,23
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 MONEY 6M N</b>	
Frais de gestion variables provisionnés	8,00
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 MONEY 6M P1/C</b>	
Frais de gestion variables provisionnés	186,59
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 MONEY 6M R</b>	
Frais de gestion variables provisionnés	3,81
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 MONEY 6M SI/C</b>	
Frais de gestion variables provisionnés	301 738,50
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

« Le montant des frais de gestion variables affiché ci-dessus correspond à la somme des provisions et reprises de provisions ayant impacté l'actif net au cours de la période sous revue. »



## TRANSPARENCE DES OPÉRATIONS DE FINANCEMENT SUR TITRES ET DE LA RÉUTILISATION DES INSTRUMENTS FINANCIERS - RÈGLEMENT SFTR - en devise de comptabilité de l'OPC (EUR)

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

### a) Titres et matières premières prêtés

Montant	0,00				
% de l'Actif Net (*)	0,00				

(\*) % hors trésorerie et équivalent de trésorerie

### b) Actifs engagés pour chaque type d'opérations de financement sur titres et TRS exprimés en valeur absolue

Montant	0,00	0,00	0,00	214 632 914,94	0,00
% de l'Actif Net	0,00	0,00	0,00	7,08	0,00

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

ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO ITALIE	0,00			213 701 779,58	0,00
---	------	--	--	----------------	------

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

BANCO BILBAO VIZCAYA ARG MADRID ESPAGNE	0,00	0,00	0,00	214 632 914,94	0,00
--	------	------	------	----------------	------

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

Type					
- Actions	0,00			0,00	0,00
- Obligations	0,00			213 701 779,58	0,00
- OPC	0,00			0,00	0,00
- TCN	0,00			0,00	0,00
- Cash	4 853 000,00		0,00		0,00
Rating	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

Monnaie de la garantie					
Euro	4 853 000,00		0,00	213 701 779,58	0,00

### f) Règlement et compensation des contrats

Triparties				X	
Contrepartie centrale					
Bilatéraux	X			X	



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

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

Moins d'1 jour	0,00			0,00	0,00
1 jour à 1 semaine	0,00			0,00	0,00
1 semaine à 1 mois	0,00			0,00	0,00
1 à 3 mois	0,00			0,00	0,00
3 mois à 1 an	0,00			99 166 064,64	0,00
Plus d'1 an	0,00			34 999 114,94	0,00
Ouvertes	0,00			79 536 600,00	0,00

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

Moins d'1 jour	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
1 jour à 1 semaine	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
1 semaine à 1 mois	0,00	0,00	0,00	214 632 914,94	0,00
1 à 3 mois	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
3 mois à 1 an	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Plus d'1 an	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Ouvertes	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

**i) Données sur la réutilisation des garanties**

Montant maximal (%)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Montant utilisé (%)	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Revenus pour l'OPC suite au réinvestissement des garanties espèces en euros	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

**j) Données sur la conservation des garanties reçues par l'OPC**

Caceis Bank					
Titres	0,00			213 701 779,58	0,00
Cash	4 853 000,00				0,00

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

Titres	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Cash	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00



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

#### I) Données sur les revenus et les coûts ventilés

Revenus					
- OPC	0,00	0,00	0,00	2 164 818,89	
- Gestionnaire	0,00	0,00	0,00	0,00	
- Tiers	0,00	0,00	0,00	0,00	
Coûts					
- OPC	0,00	0,00	0,00	-7 841,26	
- Gestionnaire	0,00	0,00	0,00	0,00	
- Tiers	0,00	0,00	0,00	0,00	

#### e) Données Type et qualité des garanties (collatéral)

Le collatéral reçu doit être conforme à la politique de NIM International définie afin de garantir un haut niveau de qualité et de liquidité ainsi qu'une absence de corrélation directe avec la contrepartie de l'opération. En complément, la politique de collatéralisation de NIM International définit des niveaux de sur-collatéralisation adaptés à chaque type de titres pour faire face le cas échéant à la variation de leur valeur. Enfin un dispositif d'appel de marges quotidien est en place afin de compenser les variations de mark to market des titres.

#### i) Données sur la réutilisation des garanties

Les OPCVM doivent impérativement réinvestir l'intégralité de leurs garanties cash (ie. montant maximal = montant maximal utilisé = 100%), mais ne peuvent réutiliser leurs garanties titres (ie. montant maximal = montant utilisé = 0%).

Par ailleurs, en cas de réception de garanties financières en espèces, celles-ci doivent, dans des conditions fixées par la réglementation, uniquement être :

- placées en dépôts ;
- investies dans des obligations d'Etat de haute qualité ;
- utilisées dans une prise en pension livrée ;
- investies dans des organismes de placement collectif (OPC) monétaire court terme.

Pour les opérations réalisées par Natixis TradEx Solutions, en mode agent ou en mode principal, les sommes reçues au titre du collatéral espèces sur les opérations de cessions temporaires de titres sont investies sur un compte de dépôts rémunéré.

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

Toutes les garanties financières fournies par l'OPC sont transférées en pleine propriété.

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

La société de gestion a confié à Natixis TradEx Solutions pour le compte de l'OPCVM la réalisation des opérations de prêts de titres et de mises en pension.



Les revenus de ces opérations sont restitués à l'OPCVM. Ces opérations engendrent des coûts qui sont supportés par l'OPCVM. La facturation de Natixis TradEx Solutions ne peut excéder 40% des revenus générés par ces opérations et est déduite des produits comptabilisés par l'OPCVM.

Les montants présentés n'intègrent pas la rémunération du placement en compte de dépôt des garanties financières reçues en espèces.



## 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>1 039 272 698,92</b>	<b>34,26</b>
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>1 039 272 698,92</b>	<b>34,26</b>
<b>Automobiles</b>			<b>20 065 560,00</b>	<b>0,66</b>
BMW FIN E3R+0.3% 20-04-27 EMTN	EUR	10 000 000	10 031 560,00	0,33
MERCEDESFIN CANADA E3R+0.26% 14-01-28	EUR	10 000 000	10 034 000,00	0,33
<b>Banques commerciales</b>			<b>229 647 985,21</b>	<b>7,57</b>
BANCO BPM 4.875% 18-01-27 EMTN	EUR	23 393 000	23 987 265,52	0,79
BELFIUS SANV E3R+0.5% 13-09-27	EUR	5 000 000	5 016 683,33	0,17
BPCE E3R+0.55% 20-01-27 EMTN	EUR	14 000 000	14 097 748,00	0,46
BQ POSTALE 0.25% 12-07-26 EMTN	EUR	9 900 000	9 858 105,37	0,32
CAN IMP BK E3R+0.38% 18-01-28	EUR	20 000 000	20 078 466,67	0,66
CAN IMP BK E3R+0.5% 17-06-27	EUR	13 000 000	13 039 271,56	0,43
CAN IMP BK E3R+0.53% 23-07-27	EUR	15 000 000	15 082 265,00	0,50
DANSKE BK E3R+0.32% 11-11-27	EUR	8 700 000	8 724 944,83	0,29
INTE E3R+0.47% 20-03-28 EMTN	EUR	25 000 000	25 022 640,97	0,83
KBC IFIMA E3R+0.3% 24-02-28	EUR	13 100 000	13 123 561,08	0,43
MORGAN STANLEY CAPITAL SERVICE 0.406% 29-10-27	EUR	4 000 000	3 952 656,44	0,13
RCI BANQUE 1.125% 15-01-27	EUR	6 000 000	5 938 279,73	0,20
RCI BANQUE 4.625% 02-10-26	EUR	14 110 000	14 496 354,99	0,48
RCI BANQUE E3R+0.71% 14-09-26	EUR	9 000 000	9 025 925,00	0,30
ROYAL BANK OF CANADA E3R+0.4% 04-11-26	EUR	10 000 000	10 043 748,33	0,33
ROYAL BANK OF CANADA E3R+0.45% 24-03-27	EUR	14 000 000	14 023 383,50	0,46
SG 3.0% 12-02-27	EUR	5 800 000	5 831 072,90	0,19
UBS GROUP AG 4.625% 17-03-28	EUR	10 000 000	10 150 973,97	0,33
UNICREDIT 5.85% 15-11-27 EMTN	EUR	7 838 000	8 154 638,02	0,27
<b>Biens de consommation durables</b>			<b>13 025 066,22</b>	<b>0,43</b>
VILOGIA STE ANONYME D HLM E3R+0.45% 24-11-26	EUR	4 000 000	4 011 730,89	0,13
VILOGIA STE ANONYME D HLM E3R+0.45% 27-05-26	EUR	3 000 000	3 007 542,83	0,10
VILOGIA STE ANONYME D HLM E3R+0.45% 29-09-26	EUR	6 000 000	6 005 792,50	0,20
<b>Boissons</b>			<b>17 297 561,88</b>	<b>0,57</b>
ANHEUSER INBEV SANV 1.15% 22-01-27	EUR	6 490 000	6 423 178,78	0,21
COCACOLA EUROPACIFIC PARTNERS E3R+0.32% 26-02-28	EUR	6 700 000	6 710 153,29	0,22
HEINEKEN NV 1.375% 29-01-27	EUR	4 200 000	4 164 229,81	0,14
<b>Composants automobiles</b>			<b>16 641 179,19</b>	<b>0,55</b>
CONTINENTAL 2.5% 27-08-26 EMTN	EUR	8 000 000	8 110 892,05	0,27
CONTINENTAL 4.0% 01-03-27 EMTN	EUR	3 965 000	4 015 343,01	0,13
ROBERT BOSCH FINANCE LLC E3R+0.45% 28-11-26	EUR	4 500 000	4 514 944,13	0,15
<b>Construction et ingénierie</b>			<b>14 254 673,52</b>	<b>0,47</b>
FERROVIAL EMISIONES 1.382% 14-05-26	EUR	14 100 000	14 254 673,52	0,47



**Inventaire des éléments de bilan**

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Courrier, fret aérien et logistique</b>			<b>5 870 407,21</b>	<b>0,19</b>
FEDEX 1.625% 11-01-27	EUR	5 893 000	5 870 407,21	0,19
<b>Crédit à la consommation</b>			<b>7 046 523,95</b>	<b>0,23</b>
CATERPILLAR FINANCIAL SERVICES E3R+0.28% 25-02-28	EUR	2 100 000	2 103 053,40	0,07
NT CONS FIN 0.5% 14-11-26 EMTN	EUR	5 000 000	4 943 470,55	0,16
<b>Distribution de produits alimentaires de première nécessité</b>			<b>2 104 769,01</b>	<b>0,07</b>
CARREFOUR 1.875% 30-10-26 EMTN	EUR	2 100 000	2 104 769,01	0,07
<b>Distribution spécialisée</b>			<b>29 701 831,78</b>	<b>0,98</b>
ARVAL SERVICE LEASE 4.0% 22-09-26	EUR	29 000 000	29 701 831,78	0,98
<b>Electricité</b>			<b>37 960 186,97</b>	<b>1,25</b>
EDF E3R+0.33% 04-03-28 EMTN	EUR	13 900 000	13 924 573,66	0,46
ENERGIAS DE PORTUGAL EDP 2.875% 01-06-26	EUR	18 800 000	19 258 794,68	0,63
RTE EDF 1.0% 19-10-26 EMTN	EUR	4 800 000	4 776 818,63	0,16
<b>FPI de détail</b>			<b>10 875 977,26</b>	<b>0,36</b>
KLEPIERRE 1.375% 16-02-27 EMTN	EUR	11 000 000	10 875 977,26	0,36
<b>Gestion immobilière et développement</b>			<b>2 524 060,96</b>	<b>0,08</b>
VONOVIA SE 1.5% 10-06-26 EMTN	EUR	2 500 000	2 524 060,96	0,08
<b>Logiciels</b>			<b>16 852 711,26</b>	<b>0,56</b>
DASSAULT SYSTEMES 0.125% 16-09-26	EUR	8 000 000	7 904 704,66	0,26
VINCI E3R+0.35% 14-01-27 EMTN	EUR	8 900 000	8 948 006,60	0,30
<b>Machines</b>			<b>5 122 156,16</b>	<b>0,17</b>
SANDVIK AB 3.0% 18-06-26 EMTN	EUR	5 000 000	5 122 156,16	0,17
<b>Marchés de capitaux</b>			<b>162 570 596,53</b>	<b>5,36</b>
ABN AMRO BK 0.6% 15-01-27	EUR	5 000 000	4 926 978,77	0,16
ABN AMRO BK E3R+0.35% 25-02-27	EUR	5 000 000	5 014 120,00	0,17
AUSTRALIA NEW ZEALAND BKING MELBOUR E3R+0.34% 29-09-27	EUR	3 000 000	3 002 148,75	0,10
BANCO NTANDER 0.5% 04-02-27	EUR	25 000 000	24 558 770,55	0,81
BANCO SANTANDER ALL SPAIN BRANCH 4.625% 18-10-27	EUR	13 000 000	13 394 605,21	0,44
FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS QUEBEC E3R+0.45% 14-01-27	EUR	15 400 000	15 495 967,67	0,51
NATL BANK OF CANADA E3R+0.4% 23-01-28	EUR	25 000 000	25 108 629,17	0,83
NATL BANK OF CANADA E3R+0.42% 16-12-27	EUR	7 000 000	7 009 125,28	0,23
NATL BANK OF CANADA E3R+0.44% 08-11-27	EUR	14 200 000	14 253 155,33	0,47
NATL BANK OF CANADA E3R+0.45% 15-09-27	EUR	5 000 000	5 009 638,89	0,17
NATL BANK OF CANADA OISEST+0.34% 12-02-27	EUR	10 000 000	10 041 299,90	0,33
NORDEA BKP E3R+0.3% 24-12-27	EUR	15 000 000	15 002 591,25	0,49
THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE I BV E3R+0.28% 01-12-27	EUR	9 700 000	9 715 890,76	0,32
VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV E3R+0.55% 14-08-26	EUR	10 000 000	10 037 675,00	0,33
<b>Outils et services appliqués aux sciences biologiques</b>			<b>30 393 987,38</b>	<b>1,00</b>
EUROFINS SCIENTIFIC SE 3.75% 17-07-26	EUR	2 825 000	2 900 567,59	0,10
PERKINELMER 1.875% 19-07-26	EUR	27 191 000	27 493 419,79	0,90



**Inventaire des éléments de bilan**

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>Producteur et commerce d'énergie indépendants</b>			<b>13 405 128,46</b>	<b>0,44</b>
STATKRAFT AS 3.125% 13-12-26	EUR	13 250 000	13 405 128,46	0,44
<b>Produits domestiques</b>			<b>11 092 308,85</b>	<b>0,37</b>
ESSITY CAPITAL BV 3.0% 21-09-26	EUR	10 900 000	11 092 308,85	0,37
<b>Services aux collectivités</b>			<b>45 257 571,22</b>	<b>1,49</b>
EDP FIN 0.375% 16-09-26 EMTN	EUR	8 000 000	7 936 433,97	0,26
ENGIE 0.0% 04-03-27 EMTN	EUR	3 500 000	3 411 275,00	0,11
ENGIE 2 3/8 05/19/26	EUR	11 900 000	12 145 637,19	0,40
ENGIE 3.625% 06-12-26 EMTN	EUR	21 400 000	21 764 225,06	0,72
<b>Services aux professionnels</b>			<b>21 765 058,08</b>	<b>0,72</b>
BUREAU VERITAS 1.125% 18-01-27	EUR	22 000 000	21 765 058,08	0,72
<b>Services clientèle divers</b>			<b>89 025 426,74</b>	<b>2,93</b>
ARVAL SERVICE LEASE SAFRANCE COMPANY 4.75% 22-05-27	EUR	7 000 000	7 411 692,05	0,24
AYVENS 3.875% 22-02-27	EUR	25 000 000	25 351 760,27	0,84
AYVENS E3R+0.68% 19-11-27	EUR	3 500 000	3 523 028,25	0,12
EDENRED 3.625% 13-12-26	EUR	5 000 000	5 080 573,29	0,17
ISS GLOBAL AS 0.875% 18-06-26	EUR	28 837 000	28 928 820,17	0,94
LEASYS 4.5% 26-07-26 EMTN	EUR	18 100 000	18 729 552,71	0,62
<b>Services de télécommunication diversifiés</b>			<b>37 603 470,50</b>	<b>1,24</b>
AT AND T INC 1.8% 05-09-26	EUR	20 435 000	20 578 579,67	0,68
ATT E3R+0.4% 16-09-27	EUR	17 000 000	17 024 890,83	0,56
<b>Services de télécommunication mobile</b>			<b>38 139 820,42</b>	<b>1,26</b>
AMERICAN TOWER 0.45% 15-01-27	EUR	28 417 000	27 949 520,89	0,92
CK HUTCHISON GROUP TELECOM FINANCE 0.75% 17-04-26	EUR	813 000	818 204,65	0,03
SWISSCOM AG VIA LUNAR FUNDING V 1.125% 12-10-26	EUR	9 400 000	9 372 094,88	0,31
<b>Services financiers diversifiés</b>			<b>130 668 044,84</b>	<b>4,31</b>
AMERICAN HONDA FIN E3R+0.55% 28-05-27	EUR	5 000 000	5 021 443,61	0,17
BERRY PLASTICS 1.5% 15-01-27	EUR	6 300 000	6 244 878,83	0,21
CA AUTO BANK SPA IRISH BRANCH E3R+0.8% 18-07-27	EUR	4 060 000	4 099 181,03	0,14
ENEL FINANCE INTL NV 1.125% 16-09-26	EUR	17 710 000	17 703 141,62	0,57
FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS QUEBEC E3R+0.4% 21-01-28	EUR	12 300 000	12 364 335,49	0,41
NTT FINANCE E3R+0.5% 16-07-27	EUR	11 600 000	11 690 266,04	0,39
PSA BANQUE FRANCE 4.0% 21-01-27	EUR	9 700 000	9 857 923,97	0,32
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV 3.125% 11-01-27	EUR	10 626 000	10 730 824,76	0,35
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0.37% 20-08-27	EUR	5 000 000	5 002 180,00	0,16
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0.43% 21-08-26	EUR	10 000 000	10 034 666,67	0,33
TRATON FINANCE LUXEMBOURG E3R+0.55% 07-05-27	EUR	5 000 000	5 016 925,00	0,17
TRATON FINANCE LUXEMBOURG E3R+0.6% 18-09-27	EUR	3 000 000	3 004 346,25	0,10
TRATON FINANCE LUXEMBOURG E3R+0.7% 21-08-26	EUR	15 000 000	15 058 730,00	0,50
VOLKSWAGEN BANK E3R+0.65% 10-12-27	EUR	5 700 000	5 717 865,86	0,19
VOLVO TREASURY AB E3R+0.35% 26-08-27	EUR	9 100 000	9 121 335,71	0,30



## Inventaire des éléments de bilan

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>SIIC spécialisées dans le crédit hypothécaire</b>			<b>5 031 441,67</b>	<b>0,17</b>
NYKREDIT E3R+0.55% 14-01-28	EUR	5 000 000	5 031 441,67	0,17
<b>Sociétés d'investissement immobilier cotées (SIIC)</b>			<b>17 398 126,02</b>	<b>0,57</b>
COVIVIO SA 1.875% 20-05-26	EUR	5 000 000	5 072 121,23	0,17
INMOBILIARIA COLONIAL 2.0% 17-04-26	EUR	12 100 000	12 326 004,79	0,40
<b>Transport routier et ferroviaire</b>			<b>7 931 067,63</b>	<b>0,26</b>
DAIMLER TRUCK INTL FINANCE BV E3R+0.48% 27-05-27	EUR	7 900 000	7 931 067,63	0,26
<b>TITRES DE CRÉANCES</b>			<b>1 535 673 238,79</b>	<b>50,62</b>
<b>Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>1 456 292 772,76</b>	<b>48,00</b>
<b>Banques commerciales</b>			<b>787 966 453,92</b>	<b>25,97</b>
AFD ZCP 15-06-26	EUR	4 000 000	3 982 065,77	0,13
AGENCE FRANCAISE D 130826 OISEST 0.26	EUR	30 000 000	30 264 788,81	1,00
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 080327	EUR	11 000 000	10 719 680,74	0,35
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 17112	EUR	20 000 000	19 678 425,02	0,65
BANKINTER, SA 091026 FIX 0.0	EUR	14 000 000	13 825 046,65	0,46
BARCLAYS BANK PLC 061126 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 537 221,88	0,97
BARCLAYS BANK PLC 201026 OISEST 0.34	EUR	30 000 000	30 318 796,95	1,00
BPCE SA 100826 OISEST 0.3	EUR	25 000 000	25 231 094,97	0,83
COMM AKTI ZCP 01-02-27	EUR	20 000 000	19 549 104,79	0,64
COMM AKTI ZCP 14-07-26	EUR	15 000 000	14 906 535,36	0,49
COMMERZBANK AG 050127 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 394 086,47	0,97
COMMERZBANK AKTIENGESELLSCHAFT 090127 FI	EUR	7 000 000	6 856 317,97	0,23
CREDIT AGRICOLE SA 230227 OISEST 0.33	EUR	20 000 000	20 046 372,02	0,66
CREDIT MUTUEL ARKEA 040826 OISEST 0.25	EUR	10 000 000	10 074 305,98	0,33
CREDIT MUTUEL ARKEA 110826 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 831 561,30	0,65
CREDIT MUTUEL ARKEA 131026 OISEST 0.32	EUR	20 000 000	20 221 856,78	0,67
CREDIT MUTUEL ARKEA 180826 OISEST 0.32	EUR	10 000 000	10 147 160,38	0,33
CREDIT MUTUEL ARKEA 240227 OISEST 0.32	EUR	10 000 000	10 022 426,90	0,33
CREDIT MUTUEL ARKEA 240626 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 898 241,06	0,66
CREDITO EMILIANO 161026 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 860 673,61	0,33
ING BANK NEDERLAND NV 011026 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 749 924,97	0,65
ING BANK NEDERLAND NV 230227 OISEST 0.32	EUR	30 000 000	30 072 729,70	0,99
ING BANK NEDERLAND NV 311226 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 404 159,34	0,97
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG 050227 F	EUR	30 000 000	29 310 825,15	0,97
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG 051126 F	EUR	15 000 000	14 770 602,45	0,49
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG 110826 F	EUR	15 000 000	14 872 508,40	0,49
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG 140926 F	EUR	15 000 000	14 833 246,29	0,49
INTESA SANPAOLO SPA 140127 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 788 911,90	0,32
LA BANQUE POSTALE. 081226 OISEST 0.31	EUR	40 000 000	40 302 606,07	1,32
LA BANQUE POSTALE. 110227 FIX 0.0	EUR	12 000 000	11 723 973,63	0,39
LA BANQUE POSTALE. 120127 OISEST 0.29	EUR	10 000 000	10 051 153,85	0,33
LCL CREDIT LYONNAIS 250926 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 819 879,19	0,49
LCL CR OISEST+0.35% 31-12-26	EUR	30 000 000	30 174 586,38	0,99
NATIONAL AUSTRALIA 260626 OISEST 0.25	EUR	20 000 000	20 343 249,30	0,67



**Inventaire des éléments de bilan**

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD LONDON 30102	EUR	15 000 000	14 779 342,93	0,49
NATIONAL BANK 130826 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 964 223,28	0,13
NATIONAL BANK OF 300626 OISEST 0.295	EUR	10 000 000	10 171 899,72	0,34
NATL AUST BANK LTD ZCP 14-08-26	EUR	10 000 000	9 912 582,18	0,33
NATL AUST BANK LTD ZCP 14-10-26	EUR	10 000 000	9 865 637,15	0,33
SANTANDER CONSUMER BANK 160726 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 965 289,15	0,16
SANTANDER CONSUMER BANK 180926 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 706 586,64	0,81
SANTANDER CONSUMER BANK 250227 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 632 350,01	0,48
SOCIETE GENERALE 021026 OISEST 0.3	EUR	30 000 000	30 308 606,67	1,00
SOCIETE GENERALE 310327 OISEST 0.345	EUR	15 000 000	15 003 678,75	0,49
SOCIETE GENERALE 310726 OISEST 0.3	EUR	5 000 000	5 072 137,41	0,17
<b>Boissons</b>			<b>19 114 113,93</b>	<b>0,63</b>
COCA COLA HBC FINANCE BV 041126 FIX 0.0	EUR	3 500 000	3 445 392,46	0,11
COCA COLA HBC FINANCE BV 071226 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 926 342,90	0,13
COCA COLA HBC FINA ZCP 11-01-27	EUR	12 000 000	11 742 378,57	0,39
<b>Composants automobiles</b>			<b>18 406 841,28</b>	<b>0,61</b>
CONTINENTAL AG 160726 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 958 437,58	0,20
CONTINENTAL AG 230726 FIX 0.0	EUR	2 500 000	2 481 413,39	0,08
OPMOBILITY 040526 FIX 0.0	EUR	5 500 000	5 487 060,82	0,18
OPMOBILITY 170626 FIX 0.0	EUR	3 000 000	2 983 080,89	0,10
VALEO SA 050526 FIX 0.0	EUR	1 500 000	1 496 848,60	0,05
<b>Construction et ingénierie</b>			<b>15 078 172,99</b>	<b>0,50</b>
GROU E E3R+0.78% 20-07-26	EUR	4 000 000	4 022 551,44	0,13
GROU E E3R+0.9% 05-02-27	EUR	4 000 000	4 029 131,44	0,13
GROU E E3R+0.9% 17-12-26	EUR	7 000 000	7 026 490,11	0,24
			<b>85 663 983,10</b>	<b>2,82</b>
CREDIT AGRICOLE LE 011226 OISEST 0.35	EUR	20 000 000	20 125 841,02	0,66
CREDIT AGRICOLE LE 030826 OISEST 0.29	EUR	20 000 000	20 161 763,19	0,66
CREDIT AGRICOLE LE 201026 OISEST 0.34	EUR	30 000 000	30 320 056,95	1,00
CREDIT AGRICOLE LE 220127 OISEST 0.35	EUR	15 000 000	15 056 321,94	0,50
<b>Electricité</b>			<b>63 534 155,71</b>	<b>2,09</b>
EDF 130526 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 987 600,58	0,16
EDF 240726 FIX 0.0	EUR	3 500 000	3 474 514,61	0,11
EDF 310726 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 883 263,29	0,49
EDF E3R+0.58% 22-01-27	EUR	15 000 000	15 089 936,26	0,50
EDF E3R+0.6% 19-05-27	EUR	25 000 000	25 098 840,97	0,83
<b>Equipements électriques</b>			<b>11 991 103,40</b>	<b>0,40</b>
NEXANS SA 130426 FIX 0.0	EUR	12 000 000	11 991 103,40	0,40
<b>Equipements et instruments électroniques</b>			<b>34 917 684,31</b>	<b>1,15</b>
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 110926 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 836 280,16	0,49
LEGR F E3R+0.35% 03-03-28	EUR	9 000 000	9 019 057,07	0,30
LEGR F E3R+0.38% 06-10-27	EUR	11 000 000	11 062 347,08	0,36



**Inventaire des éléments de bilan**

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
<b>FPI Bureautiques</b>			<b>19 921 314,41</b>	<b>0,66</b>
GECINA 130726 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 934 243,45	0,33
GECINA 230426 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 987 070,96	0,33
<b>FPI de détail</b>			<b>41 550 967,93</b>	<b>1,37</b>
KLEPIERRE 041226 FIX 0.0	EUR	2 000 000	1 965 860,55	0,06
KLEPIERRE 070526 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 968 442,03	0,49
KLEPIERRE 171226 FIX 0.0	EUR	4 000 000	3 927 590,29	0,13
KLEPIERRE 200127 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 895 884,13	0,16
KLEPIERRE 230926 FIX 0.0	EUR	6 000 000	5 931 006,74	0,20
KLEPIERRE 231026 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 862 184,19	0,33
<b>FPI Soins de Santé</b>			<b>29 856 539,33</b>	<b>0,98</b>
COFINIMMO SA 150626 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 856 539,33	0,98
<b>Gestion et promotion immobilière</b>			<b>22 243 515,22</b>	<b>0,73</b>
CDC HABITAT 081026 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 866 875,03	0,32
CDC HABITAT 100926 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 888 219,12	0,33
CDC HABITAT 150626 FIX 0.0	EUR	2 500 000	2 488 421,07	0,08
<b>Hôtels, restaurants et loisirs</b>			<b>9 956 164,94</b>	<b>0,33</b>
ACCOR SA 100626 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 956 164,94	0,33
<b>Machines</b>			<b>2 996 217,60</b>	<b>0,10</b>
FORTIVE CORPORATION 200426 FIX 0.0	EUR	3 000 000	2 996 217,60	0,10
<b>Marchés de capitaux</b>			<b>14 698 096,20</b>	<b>0,48</b>
BANCO SANTANDER (ALL SPAIN BRCH) 060127	EUR	15 000 000	14 698 096,20	0,48
<b>Outils et services appliqués aux sciences biologiques</b>			<b>26 753 059,24</b>	<b>0,88</b>
DANAHER CORP 170926 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 882 331,19	0,32
DANAHER CORP 180926 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 881 514,06	0,33
EUROFINS SCIENTIFIC SE 240426 FIX 0.0	EUR	7 000 000	6 989 213,99	0,23
<b>Produits alimentaires</b>			<b>2 399 845,99</b>	<b>0,08</b>
BONDUELLE 020426 FIX 0.0	EUR	2 400 000	2 399 845,99	0,08
<b>Services aux collectivités</b>			<b>14 974 475,18</b>	<b>0,49</b>
VEOLIA ENVIRONNEMENT 300426 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 974 475,18	0,49
<b>Services de télécommunication diversifiés</b>			<b>13 826 609,85</b>	<b>0,46</b>
TELUS CORP 150726 FIX 0.0	USD	7 000 000	6 028 650,20	0,20
TELUS CORP 260526 FIX 0.0	USD	9 000 000	7 797 959,65	0,26
<b>Services financiers diversifiés</b>			<b>192 291 863,91</b>	<b>6,34</b>
AVRIL SCA 190626 FIX 0.0	EUR	3 000 000	2 983 305,92	0,10
BANQ F OISEST+0.315% 16-11-26	EUR	35 000 000	35 096 541,53	1,17
BANQUE STELLANTIS FRANCE 141026 OISEST 0	EUR	15 000 000	15 164 577,61	0,50
CA CONSUMER FINANCE 010227 OISEST 0.35	EUR	20 000 000	20 075 546,80	0,66
CA CONSUMER FINANCE 080127 FIX 0.0	EUR	25 000 000	24 485 601,19	0,81
CA CONSUMER FINANCE 300726 FIX 0.0	EUR	20 000 000	19 848 187,83	0,65
EUROFACTOR 311226 OISEST 0.35	EUR	20 000 000	20 106 209,67	0,66



**Inventaire des éléments de bilan**

Désignation des valeurs par secteur d'activité (*)	Devise	Quantité ou Nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
MEDIOBANCA INTERNATIONAL (LUX) 130826 FI	EUR	20 000 000	19 830 040,90	0,65
MEDIOBANCA INTERNATIONAL LTD 150526 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 962 959,36	0,49
THE TORONTO-DO 121026 FIX 0.0	EUR	15 000 000	14 800 067,86	0,49
THE TORONTO-DO 280926 FIX 0.0	EUR	5 000 000	4 938 825,24	0,16
<b>Services liés aux technologies de l'information</b>			<b>19 683 519,47</b>	<b>0,65</b>
THALES SERVICES SAS 230327 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 739 061,75	0,32
THALES SERVICES SAS 300626 FIX 0.0	EUR	10 000 000	9 944 457,72	0,33
<b>Sociétés d'investissement immobilier cotées (SIIC)</b>			<b>2 994 188,70</b>	<b>0,10</b>
COVIVIO SA 040526 FIX 0.0	EUR	3 000 000	2 994 188,70	0,10
<b>Transport routier et ferroviaire</b>			<b>5 473 886,15</b>	<b>0,18</b>
PROSEGUR CASH SA 030726 FIX 0.0	EUR	1 300 000	1 291 764,81	0,04
PROSEGUR CASH SA 040626 FIX 0.0	EUR	4 200 000	4 182 121,34	0,14
<b>Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>79 380 466,03</b>	<b>2,62</b>
<b>Banques commerciales</b>			<b>69 467 590,20</b>	<b>2,29</b>
INTE BANK LUXE ZCP 10-07-26	EUR	25 000 000	24 845 262,33	0,82
INTE BANK LUXE ZCP 13-08-26	EUR	15 000 000	14 870 269,62	0,49
UNICREDIT S.P.A. 110826 FIX 0.0	EUR	30 000 000	29 752 058,25	0,98
<b>Boissons</b>			<b>2 971 960,05</b>	<b>0,10</b>
COCA COLA HBC FINANCE BV 190826 FIX 0.0	EUR	3 000 000	2 971 960,05	0,10
<b>Services de télécommunication diversifiés</b>			<b>6 940 915,78</b>	<b>0,23</b>
TELEFONICA EUROPE BV 030626 FIX 0.0	EUR	3 500 000	3 486 402,25	0,11
TELUS CORP 220626 FIX 0.0	USD	4 000 000	3 454 513,53	0,12
<b>TITRES D'OPC</b>			<b>214 579 586,76</b>	<b>7,07</b>
<b>OPCVM</b>			<b>214 579 586,76</b>	<b>7,07</b>
<b>Gestion collective</b>			<b>214 579 586,76</b>	<b>7,07</b>
OSTRUM EURO LIQUIDITIY LVNAV Part SI	EUR	361,21	91 699 288,23	3,02
OSTRUM SRI CASH Part M	EUR	11 335,15214	122 879 963,64	4,05
OSTRUM SRI CASH PLUS I	EUR	0,003	334,89	0,00
<b>TITRES FINANCIERS REÇUS EN PENSION</b>			<b>214 632 914,94</b>	<b>7,08</b>
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>214 632 914,94</b>	<b>7,08</b>
<b>Services aux collectivités</b>			<b>214 632 914,94</b>	<b>7,08</b>
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.8% 01-12-28	EUR	34 431 000	34 999 114,94	1,15
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.95% 15-02-27	EUR	98 000 000	100 097 200,00	3,31
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.25% 15-11-32	EUR	78 000 000	79 536 600,00	2,62
<b>INDEMNITÉS SUR TITRES REÇUS EN PENSION</b>			<b>845 526,36</b>	<b>0,03</b>
<b>Total</b>			<b>3 005 003 965,77</b>	<b>99,06</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 (*)
CAT USD EUR 260526	0,00	-134 997,59	EUR	7 670 091,60	USD	-7 805 089,19
V/USD/EUR/20260622	0,00	-88 707,75	EUR	3 369 660,14	USD	-3 458 367,89
V/USD/EUR/20260715	0,00	-99 892,58	EUR	5 937 132,60	USD	-6 037 025,18
<b>Total</b>	<b>0,00</b>	<b>-323 597,92</b>		<b>16 976 884,34</b>		<b>-17 300 482,26</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/1.8448/OISEST/0.	10 000 000	0,00	-7 283,61	10 000 000,00
FIX/1.8473/OISEST/0.	5 000 000	0,00	-3 064,72	5 000 000,00
FIX/2.0933/OISEST/0.	3 000 000	3 708,97	0,00	3 000 000,00
FIX/2.7808/OISEST/0.	2 800 000	23 184,67	0,00	2 800 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.693	10 000 000	28 929,90	0,00	10 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.722	15 000 000	38 004,59	0,00	15 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.729	5 000 000	10 852,92	0,00	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.734	3 500 000	9 262,41	0,00	3 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.738	8 000 000	18 176,28	0,00	8 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.745	15 000 000	35 890,47	0,00	15 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.750	20 000 000	45 101,94	0,00	20 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.758	25 000 000	56 676,17	0,00	25 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.761	6 000 000	19 787,57	0,00	6 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.763	5 000 000	11 389,79	0,00	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.769	12 000 000	35 918,70	0,00	12 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.771	15 000 000	29 304,56	0,00	15 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.800	11 710 000	31 767,10	0,00	11 710 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.821	10 626 000	48 791,28	0,00	10 626 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.821	5 000 000	18 370,95	0,00	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.823	7 000 000	56 286,23	0,00	7 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.831	9 600 000	36 846,44	0,00	9 600 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.833	4 000 000	7 549,08	0,00	4 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.838	15 000 000	19 606,86	0,00	15 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.855	15 000 000	31 880,10	0,00	15 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.861	18 417 000	78 737,15	0,00	18 417 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.872	12 900 000	54 458,48	0,00	12 900 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.873	6 490 000	27 805,73	0,00	6 490 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.873	15 000 000	40 652,87	0,00	15 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.876	14 000 000	32 411,36	0,00	14 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.879	5 893 000	23 677,55	0,00	5 893 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.880	25 000 000	48 530,95	0,00	25 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.881	30 000 000	82 549,30	0,00	30 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.883	3 800 000	17 454,06	0,00	3 800 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.888	2 000 000	8 124,29	0,00	2 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.891	5 000 000	9 921,59	0,00	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.892	10 000 000	39 657,99	0,00	10 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.895	3 200 000	12 758,19	0,00	3 200 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.897	30 000 000	31 981,97	0,00	30 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.901	30 000 000	127 627,65	0,00	30 000 000,00



## 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/1.901	20 000 000	83 385,10	0,00	20 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.902	23 000 000	88 828,03	0,00	23 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.908	8 000 000	0,00	-1 751,93	8 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.931	25 000 000	108 780,73	0,00	25 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.939	30 000 000	99 144,92	0,00	30 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.952	12 100 000	20 835,58	0,00	12 100 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.971	13 000 000	3 966,95	0,00	13 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.977	5 000 000	17 526,26	0,00	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.018	14 500 000	0,00	-3 169,55	14 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.026	5 000 000	7 441,45	0,00	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.042	4 300 000	0,00	-3 464,68	4 300 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.046	3 000 000	0,00	-2 436,47	3 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.048	5 000 000	2 043,51	0,00	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.055	9 922 000	0,00	-5 898,42	9 922 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.060	10 000 000	0,00	-8 586,95	10 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.079	5 000 000	0,00	-5 710,39	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.086	5 000 000	3 246,81	0,00	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.094	8 100 000	0,00	-10 411,37	8 100 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.096	9 200 000	0,00	-10 285,17	9 200 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.137	5 000 000	0,00	-7 322,29	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.155	11 500 000	0,00	-13 135,99	11 500 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.161	3 000 000	0,00	-5 774,22	3 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.170	4 000 000	0,00	-8 458,28	4 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.171	7 000 000	0,00	-14 873,17	7 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.220	5 000 000	3 466,78	0,00	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.271	5 000 000	0,00	-15 321,49	5 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/2.343	2 000 000	0,00	-7 231,38	2 000 000,00
OISEST/0.0/FIX/3.110	2 800 000	0,00	-32 455,96	2 800 000,00
OISEST/0.0/FIX/1.9178	9 922 000	0,00	-941,40	9 922 000,00
<b>Sous-total 3.</b>		<b>1 692 302,23</b>	<b>-167 577,44</b>	<b>720 280 000,00</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>1 692 302,23</b>	<b>-167 577,44</b>	<b>720 280 000,00</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>		<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 - 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>		<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 - 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>		<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 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)	3 005 003 965,77
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	-323 597,92
Total instruments financiers à terme - actions	0,00
Total instruments financiers à terme - taux	1 524 724,79
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 (+)	34 325 857,33
Autres passifs (-)	-6 989 644,50
Passifs de financement (-)	0,00
<b>Total = actif net</b>	<b>3 033 541 305,47</b>

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part OSTRUM SRI MONEY 6M E	EUR	2 113,32971	11 288,95
Part OSTRUM SRI MONEY 6M I	EUR	61 048,62260	11 460,51
Part OSTRUM SRI MONEY 6M N	EUR	14 455,09487	100,12
Part OSTRUM SRI MONEY 6M R	EUR	7 924,51724	104,79
Part OSTRUM SRI MONEY 6M SI/C	EUR	9 011,99298	256 076,27



**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