



# NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

OPCVM de droit français

## **OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3**

### **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	39 713 990,27
b) Avoirs bancaires	40 301,37
c) Autres actifs détenus par l'OPC	517 932,08
d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c)	40 272 223,72
e) Passif	-9 364,46
f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC)	40 262 859,26

(\*) 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 EURO BONDS 1-3 I en EUR	C	29 791 352,55	9 237,0860	3 225,18
OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3 M en EUR	C	1 096 646,99	480,0000	2 284,68
OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3 R C en EUR	C	8 723 250,69	79 605,5811	109,58
OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3 R D en EUR	D	651 609,03	7 450,3776	87,45



## 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.	98,64	98,61
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.	0,00	0,00
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.	1,07	1,06

(\*) 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	39 713 990,27	98,64	98,61
<b>TOTAL</b>		<b>39 713 990,27</b>	<b>98,64</b>	<b>98,61</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 (**)
ALLEMAGNE	31,52	31,51
ITALIE	25,64	25,63
FRANCE	21,45	21,45
ESPAGNE	12,28	12,28
BELGIQUE	5,25	5,25
LUXEMBOURG	2,50	2,50
<b>TOTAL</b>	<b>98,64</b>	<b>98,61</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	1,07	1,06
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>1,07</b>	<b>1,06</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.	17 756 235,00	14 118 959,00
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.	0,00	0,00
D) Les titres financiers éligibles nouvellement émis mentionnés au 4° du I de l'article R. 214-11 du code monétaire et financier.	0,00	0,00
E) Les autres actifs.	8 212 330,04	7 789 781,73

## DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

	Part	Montant net unitaire EUR	Crédit d'impôt EUR	Montant brut unitaire EUR
<b>Dividendes versés</b>				
22/05/2024	OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3 R D	1,87	0,001	1,87
<b>Dividendes à verser</b>				
	OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3 R D			

## 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



## **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>39 713 990,27</b>	<b>98,63</b>
<b>Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé</b>			<b>39 713 990,27</b>	<b>98,63</b>
<b>Banques commerciales</b>			<b>5 678 989,92</b>	<b>14,10</b>
KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU KFW 2.75% 01-10-27	EUR	5 600 000	5 678 989,92	14,10
<b>Services aux collectivités</b>			<b>34 035 000,35</b>	<b>84,53</b>
BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 2.3% 15-02-33	EUR	200 000	207 162,71	0,51
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 2.5% 13-03-25	EUR	1 000	1 011,99	0,00
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 2.8% 12-06-25	EUR	1 000	1 009,29	0,00
BUNDESSCHATZANWEISUNGEN 3.1% 18-09-25	EUR	1 000	1 006,82	0,00
BUNDSOBLIGATION 0.0% 10-10-25	EUR	5 380 000	5 256 206,20	13,05
EUROPEAN FINL STABILITY FACIL 2.5% 15-12-27	EUR	1 000 000	1 007 600,87	2,50
EUROPEAN UNION 0.8% 04-07-25	EUR	1 100 000	1 086 032,86	2,70
EUROPEAN UNION 2.875% 06-12-27	EUR	1 000 000	1 028 425,55	2,55
FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 2.5% 24-09-26	EUR	8 600 000	8 637 564,33	21,48
GERMANY 0.5% 15-02-26	EUR	100 000	98 124,21	0,24
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.0% 01-08-26	EUR	800 000	765 944,00	1,90
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.95% 15-02-27	EUR	2 500 000	2 538 194,57	6,30
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.6% 29-09-25	EUR	4 900 000	4 943 111,88	12,28
ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.8% 15-04-26	EUR	2 000 000	2 074 160,55	5,15
REPUBLIQUE FEDERALE D GERMANY 0.25% 15-02-27	EUR	1 500 000	1 445 446,56	3,59
SPAIN GOVERNMENT BOND 1.3% 31-10-26	EUR	1 500 000	1 488 569,92	3,70
SPAIN GOVERNMENT BOND 2.8% 31-05-26	EUR	2 400 000	2 439 221,59	6,06
SPGB 2.15 10/31/25	EUR	1 000 000	1 016 206,45	2,52
<b>TITRES D'OPC</b>			<b>428 820,23</b>	<b>1,07</b>
<b>OPCVM</b>			<b>428 820,23</b>	<b>1,07</b>
<b>Gestion collective</b>			<b>428 820,23</b>	<b>1,07</b>
OSTRUM SRI CASH Part M	EUR	41	428 820,23	1,07
<b>Total</b>			<b>40 142 810,50</b>	<b>99,70</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 (*)
<b>Total</b>	<b>0,00</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 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>				
<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 - 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>		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)	40 142 810,50
Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) :	
Total opérations à terme de devises	0,00
Total instruments financiers à terme - actions	0,00
Total instruments financiers à terme - taux	0,00
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 (+)	129 413,22
Autres passifs (-)	-9 364,46
Passifs de financement (-)	0,00
<b>Total = actif net</b>	<b>40 262 859,26</b>

Libellé de la part	Devise de la part	Nombre de parts	Valeur liquidative
Part OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3 I	EUR	9 237,0860	3 225,18
Part OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3 M	EUR	480,0000	2 284,68
Part OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3 R C	EUR	79 605,5811	109,58
Part OSTRUM SRI EURO BONDS 1-3 R D	EUR	7 450,3776	87,45



**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