



NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

OPCVM de droit français

OSTRUM SRI MONEY

RAPPORT SEMESTRIEL

au 30 décembre 2025

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 | 8 286 581 357,21 |
| b) Avoirs bancaires | 474 474 197,50 |
| c) Autres actifs détenus par l'OPC | 950 576 668,25 |
| d) Total des actifs détenus par l'OPC (lignes a+b+c) | 9 711 632 222,96 |
| e) Passif | -6 261 444,13 |
| f) Valeur nette d'inventaire (lignes d+e = actif net de l'OPC) | 9 705 370 778,83 |

(*) 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 I1 en EUR | C/D | 17 537 950,46 | 42 737,04746 | 410,368 |
| OSTRUM SRI MONEY I C en EUR | C | 6 040 634 777,99 | 445 106,13270 | 13 571,22 |
| OSTRUM SRI MONEY I-D en EUR | D | 21 636 818,32 | 1 784,65381 | 12 123,81 |
| OSTRUM SRI MONEY N en EUR | C | 828 326,71 | 7 643,27535 | 108,37 |
| OSTRUM SRI MONEY R en EUR | C | 2 774 160 588,70 | 256 784,57440 | 10 803,45 |
| OSTRUM SRI MONEY R1 en EUR | C/D | 125 719 453,30 | 959 882,04035 | 130,973 |
| OSTRUM SRI MONEY RE C en EUR | C | 715 696 302,11 | 66 183,01275 | 10 813,89 |
| OSTRUM SRI MONEY T C en EUR | C | 9 156 561,24 | 847,58886 | 10 803,06 |



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. | 64,27 | 64,23 |
| 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. | 14,12 | 14,11 |
| 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. | 16,74 | 16,73 |

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

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

**RÉPARTITION DES ACTIFS DU A), B), C), D) DU PORTEFEUILLE TITRES, PAR DEVISE**

| Titres | Devise | En montant (EUR) | Pourcentage actif net (*) | Pourcentage total des actifs (**) |
|-------------------|--------|-------------------------|---------------------------|-----------------------------------|
| Euro | EUR | 7 422 914 014,62 | 76,48 | 76,43 |
| Dollar Us | USD | 131 206 345,05 | 1,35 | 1,35 |
| Couronne Suédoise | SEK | 53 826 382,54 | 0,55 | 0,55 |
| TOTAL | | 7 607 946 742,21 | 78,39 | 78,34 |

(*) 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 | 39,88 | 39,86 |
| ROYAUME-UNI | 6,67 | 6,67 |
| LUXEMBOURG | 6,03 | 6,02 |
| PAYS-BAS | 5,85 | 5,85 |
| ITALIE | 3,90 | 3,89 |
| CANADA | 3,25 | 3,25 |
| ESPAGNE | 3,10 | 3,10 |
| ETATS-UNIS | 2,90 | 2,90 |
| ALLEMAGNE | 1,61 | 1,61 |
| BELGIQUE | 1,34 | 1,34 |
| SUEDE | 1,34 | 1,34 |
| DANEMARK | 0,45 | 0,45 |
| AUSTRALIE | 0,42 | 0,42 |
| PORTUGAL | 0,41 | 0,41 |
| AUTRICHE | 0,38 | 0,38 |
| FINLANDE | 0,36 | 0,36 |
| ILES CAIMANS | 0,20 | 0,20 |
| JAPON | 0,15 | 0,15 |
| IRLANDE | 0,13 | 0,13 |
| TOTAL | 78,39 | 78,34 |

(*) 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 | 9,75 | 9,74 |
| 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 | 6,99 | 6,99 |
| TOTAL | 16,74 | 16,73 |

(*) 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. | 7 244 874 254,22 | 8 256 080 880,25 |
| 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. | 2 104 773 088,82 | 2 828 733 778,82 |
| 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. | 557 545 915,52 | 498 930 848,11 |

DISTRIBUTION EN COURS DE PÉRIODE

| | Part | Montant net unitaire EUR | Crédit d'impôt EUR | Montant brut unitaire EUR |
|----------------------------|----------------------|--------------------------|--------------------|---------------------------|
| Dividendes versés | | | | |
| | OSTRUM SRI MONEY I1 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| 11/09/2025 | OSTRUM SRI MONEY I-D | 394,87 | 0,00 | 394,87 |
| | OSTRUM SRI MONEY R1 | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Dividendes à verser | | | | |
| | OSTRUM SRI MONEY I1 | | | |
| | OSTRUM SRI MONEY I-D | | | |
| | OSTRUM SRI MONEY R1 | | | |

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**

| | 30/12/2025 |
|--|------------|
| Part OSTRUM SRI MONEY I1 | |
| Frais de gestion variables provisionnés | 1 904,27 |
| 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 |
| Part OSTRUM SRI MONEY I C | |
| Frais de gestion variables provisionnés | 936 836,29 |
| 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 |
| Part OSTRUM SRI MONEY I-D | |
| Frais de gestion variables provisionnés | 2 250,08 |
| 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 |
| Part OSTRUM SRI MONEY N | |
| Frais de gestion variables provisionnés | 459,23 |
| Pourcentage de frais de gestion variables provisionnés | 0,02 |
| Frais de gestion variables acquis | 0,00 |
| Pourcentage de frais de gestion variables acquis | 0,00 |
| Part OSTRUM SRI MONEY R | |
| Frais de gestion variables provisionnés | 40 884,27 |
| 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 MONEY R1 | |
| Frais de gestion variables provisionnés | 13 984,23 |
| 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 |
| Part OSTRUM SRI MONEY RE C | |
| Frais de gestion variables provisionnés | 12 331,75 |
| 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. »



| | 30/12/2025 |
|--|------------|
| Part OSTRUM SRI MONEY T C | |
| Frais de gestion variables provisionnés | 140,66 |
| 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 | | | 2 242 459 766,82 | 23,11 |
| Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé | | | 1 563 825 151,82 | 16,12 |
| Assurance | | | 4 301 877,04 | 0,04 |
| SWISSCOM FINANCE BV 3.5% 29-05-26 | EUR | 4 200 000 | 4 301 877,04 | 0,04 |
| Automobiles | | | 24 650 310,00 | 0,25 |
| BMW FIN E3R+0.3% 20-04-27 EMTN | EUR | 20 000 000 | 20 090 280,00 | 0,20 |
| RENAULT 2.375% 25-05-26 EMTN | EUR | 4 500 000 | 4 560 030,00 | 0,05 |
| Banques commerciales | | | 496 547 162,19 | 5,13 |
| BBVA 0.125% 24-03-27 EMTN | EUR | 20 000 000 | 19 923 646,58 | 0,21 |
| BBVA 0.5% 14-01-27 | EUR | 13 100 000 | 12 908 013,22 | 0,13 |
| BK AMERICA E3R+0.48% 10-03-27 | EUR | 38 800 000 | 38 879 001,11 | 0,41 |
| BNP PAR 1.125% 11-06-26 EMTN | EUR | 14 500 000 | 14 517 632,40 | 0,15 |
| BNP PAR 2.125% 23-01-27 EMTN | EUR | 25 000 000 | 25 493 318,49 | 0,26 |
| BPCE 0.25% 15-01-26 | EUR | 20 000 000 | 20 033 608,22 | 0,21 |
| BPCE E3R+0.39% 06-03-26 EMTN | EUR | 30 000 000 | 30 059 525,00 | 0,31 |
| BPCE E3R+0.55% 20-01-27 EMTN | EUR | 25 000 000 | 25 190 001,39 | 0,26 |
| BPCE ISSUER 0.5% 24-02-27 EMTN | EUR | 8 000 000 | 7 855 383,01 | 0,08 |
| CAN IMP BK E3R+0.4% 27-03-26 | EUR | 25 000 000 | 25 015 429,17 | 0,26 |
| CAN IMP BK E3R+0.47% 17-07-26 | EUR | 30 000 000 | 30 192 303,33 | 0,31 |
| CAN IMP BK E3R+0.5% 17-06-27 | EUR | 20 000 000 | 20 073 575,56 | 0,21 |
| CAN IMP BK E3R+0.53% 23-07-27 | EUR | 30 000 000 | 30 175 820,00 | 0,31 |
| CREDIT AGRICOLE 3.125% 02/16 | EUR | 16 000 000 | 16 462 275,07 | 0,17 |
| DANSKE BK 4.0% 12-01-27 | EUR | 7 000 000 | 7 276 047,40 | 0,07 |
| DANSKE BK E3R+0.32% 11-11-27 | EUR | 11 600 000 | 11 640 484,32 | 0,12 |
| INTE 0.625% 24-02-26 EMTN | EUR | 5 563 000 | 5 578 693,76 | 0,06 |
| INTE 1.0% 19-11-26 EMTN | EUR | 14 062 000 | 13 922 129,33 | 0,14 |
| JPM CHASE 1.09% 11-03-27 EMTN | EUR | 10 000 000 | 10 063 297,26 | 0,10 |
| MIZUHO FINANCIAL GROUP 0.184% 13-04-26 | EUR | 14 800 000 | 14 735 852,75 | 0,15 |
| RCI BANQUE E3R+0.71% 14-09-26 | EUR | 18 000 000 | 18 057 615,00 | 0,19 |
| ROYAL BANK OF CANADA E3R+0.4% 04-11-26 | EUR | 20 000 000 | 20 099 511,11 | 0,21 |
| ROYAL BANK OF CANADA E3R+0.45% 24-03-27 | EUR | 28 000 000 | 28 050 176,00 | 0,29 |
| SVENSKA HANDELSBANKEN AB 3.75% 05-05-26 | EUR | 12 000 000 | 12 353 697,53 | 0,13 |
| UBS AG LONDON BRANCH E3R+0.38% 21-11-27 | EUR | 6 000 000 | 6 021 479,00 | 0,06 |
| UNICREDIT 0.325% 19-01-26 EMTN | EUR | 31 900 000 | 31 968 646,18 | 0,33 |
| Biens de consommation durables | | | 39 078 877,89 | 0,40 |
| VILOGIA STE ANONYME D HLM E3R+0.45% 24-11-26 | EUR | 12 000 000 | 12 042 288,00 | 0,12 |
| VILOGIA STE ANONYME D HLM E3R+0.45% 27-05-26 | EUR | 14 000 000 | 14 034 528,67 | 0,15 |
| VILOGIA STE ANONYME D HLM E3R+0.45% 29-09-26 | EUR | 13 000 000 | 13 002 061,22 | 0,13 |
| Crédit à la consommation | | | 6 898 290,96 | 0,07 |
| NT CONS FIN 0.5% 14-11-26 EMTN | EUR | 7 000 000 | 6 898 290,96 | 0,07 |



Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*) | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle | % Actif Net |
|---|--------|---------------------|-----------------------|-------------|
| Electricité | | | 6 334 733,97 | 0,07 |
| ORSTED 3.625% 01-03-26 EMTN | EUR | 6 143 000 | 6 334 733,97 | 0,07 |
| Gestion immobilière et développement | | | 6 058 440,82 | 0,06 |
| VONOVIA SE 1.5% 22-03-26 EMTN | EUR | 6 000 000 | 6 058 440,82 | 0,06 |
| Industrie aérospatiale et défense | | | 4 485 238,77 | 0,05 |
| SAFFP 0 ? 03/16/26 Corp | EUR | 4 500 000 | 4 485 238,77 | 0,05 |
| Logiciels | | | 35 198 297,36 | 0,36 |
| VINCI E3R+0.35% 14-01-27 EMTN | EUR | 35 000 000 | 35 198 297,36 | 0,36 |
| Machines | | | 11 246 557,21 | 0,12 |
| FORTIVE 3.7% 13-02-26 | EUR | 12 000 000 | 6 152 870,22 | 0,07 |
| SANDVIK AB 3.0% 18-06-26 EMTN | EUR | 5 000 000 | 5 093 686,99 | 0,05 |
| Marchés de capitaux | | | 254 867 741,71 | 2,63 |
| ABN AMRO BK 0.6% 15-01-27 | EUR | 10 000 000 | 9 879 969,86 | 0,10 |
| ABN AMRO BK E3R+0.35% 25-02-27 | EUR | 20 900 000 | 20 972 531,71 | 0,22 |
| AUSTRALIA NEW ZEALAND BKING MELBOUR E3R+0.34% 29-09-27 | EUR | 13 000 000 | 13 010 991,50 | 0,13 |
| BANCO NTANDER 0.5% 04-02-27 | EUR | 22 500 000 | 22 142 179,11 | 0,23 |
| BANK OF NOVA SCOTIA E3R+0.4% 17-06-26 | EUR | 30 000 000 | 30 051 680,00 | 0,31 |
| CRED SUIS SA AG LONDON BRANCH 0.25% 05-01-26 | EUR | 7 347 000 | 7 365 065,57 | 0,08 |
| FEDERATION DES CAISSES DESJARDINS QUEBEC E3R+0.45% 14-01-27 | EUR | 30 800 000 | 31 013 121,46 | 0,33 |
| NATL BANK OF CANADA E3R+0.42% 16-12-27 | EUR | 10 000 000 | 10 012 730,00 | 0,10 |
| NATL BANK OF CANADA E3R+0.44% 08-11-27 | EUR | 14 200 000 | 14 256 622,50 | 0,15 |
| NATL BANK OF CANADA E3R+0.45% 06-03-26 | EUR | 19 400 000 | 19 442 308,17 | 0,20 |
| NATL BANK OF CANADA E3R+0.45% 15-09-27 | EUR | 15 000 000 | 15 031 837,50 | 0,15 |
| NATL BANK OF CANADA OISEST+0.33% 07-08-26 | EUR | 10 000 000 | 10 036 745,76 | 0,10 |
| NORDEA BKP E3R+0.3% 24-12-27 | EUR | 10 000 000 | 10 005 576,11 | 0,10 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE I BV E3R+0.28% 01-12-27 | EUR | 16 500 000 | 16 536 890,79 | 0,17 |
| VOLKSWAGEN INTL FINANCE NV E3R+0.55% 14-08-26 | EUR | 25 000 000 | 25 109 491,67 | 0,26 |
| Produits pour l'industrie du bâtiment | | | 13 080 493,15 | 0,13 |
| COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN 1.125% 23-03-26 | EUR | 13 000 000 | 13 080 493,15 | 0,13 |
| Services aux collectivités | | | 22 251 895,55 | 0,23 |
| ENGIE 1.0% 13-03-26 EMTN | EUR | 8 500 000 | 8 547 770,00 | 0,09 |
| ENGIE 2 3/8 05/19/26 | EUR | 13 500 000 | 13 704 125,55 | 0,14 |
| Services clientèle divers | | | 87 644 689,33 | 0,90 |
| LEASYS E3R+0.75% 08-04-26 EMTN | EUR | 87 000 000 | 87 644 689,33 | 0,90 |
| Services de télécommunication diversifiés | | | 34 077 697,56 | 0,35 |
| ATT E3R+0.4% 16-09-27 | EUR | 34 000 000 | 34 077 697,56 | 0,35 |
| Services financiers diversifiés | | | 484 355 597,62 | 4,99 |
| AMERICAN HONDA FIN E3R+0.55% 28-05-27 | EUR | 20 000 000 | 20 097 960,00 | 0,21 |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL BFCM 0.01% 11-05-26 | EUR | 11 000 000 | 10 913 692,19 | 0,11 |
| BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL BFCM 2.375% 24-03-26 | EUR | 10 000 000 | 10 182 242,47 | 0,10 |



Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*) | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle | % Actif Net |
|---|--------|---------------------|-------------------------|--------------|
| BMW US LLC E3R+0.37% 29-01-27 | EUR | 10 000 000 | 10 051 363,33 | 0,10 |
| CA AUTO BANK SPA IRISH BRANCH E3R+0.8% 26-01-26 | EUR | 12 700 000 | 12 771 035,33 | 0,13 |
| DH EUROPE FINANCE II SARL 0.2% 18-03-26 | EUR | 7 950 000 | 7 927 999,19 | 0,08 |
| HIGHLAND HOLDINGS SARL 0.318% 15-12-26 | EUR | 7 500 000 | 7 352 255,14 | 0,08 |
| PURPLE PROTECTED ASSET OISEST+0.17% 04-05-26 | EUR | 125 000 000 | 126 805 647,71 | 1,32 |
| PURPLE PROTECTED ASSET OISEST+0.18% 16-10-26 | EUR | 125 000 000 | 125 542 820,83 | 1,29 |
| RICHEMONT INTL 1.0% 26-03-26 | EUR | 8 000 000 | 8 038 190,68 | 0,08 |
| TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0.37% 20-08-27 | EUR | 7 800 000 | 7 824 492,00 | 0,08 |
| TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0.4% 30-04-26 | EUR | 9 000 000 | 9 045 738,50 | 0,09 |
| TRATON FINANCE LUXEMBOURG E3R+0.55% 07-05-27 | EUR | 15 000 000 | 15 050 541,67 | 0,16 |
| TRATON FINANCE LUXEMBOURG E3R+0.6% 18-09-27 | EUR | 12 000 000 | 12 015 668,00 | 0,12 |
| TRATON FINANCE LUXEMBOURG E3R+0.7% 21-08-26 | EUR | 20 000 000 | 20 100 130,00 | 0,21 |
| TRATON FINANCE LUXEMBOURG E3R+1.0% 21-01-26 | EUR | 10 000 000 | 10 062 727,78 | 0,10 |
| VOLKSWAGEN BANK E3R+0.65% 10-12-27 | EUR | 11 400 000 | 11 439 678,33 | 0,12 |
| VOLVO TREASURY AB 3.125% 08-09-26 | EUR | 5 000 000 | 5 072 673,29 | 0,05 |
| VOLVO TREASURY AB E3R+0.35% 26-08-27 | EUR | 16 800 000 | 16 845 950,80 | 0,17 |
| VOLVO TREASURY AB E3R+0.4% 10-01-27 | EUR | 23 700 000 | 23 861 936,18 | 0,25 |
| VOLVO TREASURY AB E3R+0.4% 22-11-26 | EUR | 13 300 000 | 13 352 854,20 | 0,14 |
| Sociétés d'investissement immobilier cotées (SIIC) | | | 27 691 181,51 | 0,29 |
| HALEON NETHERLANDS CAPITAL BV 1.25% 29-03-26 | EUR | 27 500 000 | 27 691 181,51 | 0,29 |
| Transport routier et ferroviaire | | | 5 056 069,18 | 0,05 |
| PROSEGUR CASH 1.375% 04-02-26 | EUR | 5 000 000 | 5 056 069,18 | 0,05 |
| Obligations et valeurs assimilées non négociées sur un marché réglementé ou assimilé | | | 678 634 615,00 | 6,99 |
| Services financiers diversifiés | | | 678 634 615,00 | 6,99 |
| CODEIS SECURITIES OISEST+0.17% 15-06-26 | EUR | 150 000 000 | 151 763 858,75 | 1,56 |
| CODEIS SECURITIES OISEST+0.18% 14-12-26 | EUR | 250 000 000 | 250 263 875,00 | 2,58 |
| PURPLE PROTECTED ASSET OISEST+0.18% 18-11-26 | EUR | 175 000 000 | 175 430 975,42 | 1,81 |
| SG LUXEMBOURG OISEST+0.17% 15-06-26 | EUR | 100 000 000 | 101 175 905,83 | 1,04 |
| TITRES DE CRÉANCES | | | 6 044 121 590,39 | 62,27 |
| Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé | | | 5 689 576 217,69 | 58,62 |
| Automobiles | | | 49 448 627,92 | 0,51 |
| General Motors Financial Co Inc 100326 F | USD | 12 500 000 | 10 539 679,99 | 0,11 |
| RENAULT SA 100226 FIX 0.0 | EUR | 7 000 000 | 6 982 387,55 | 0,07 |
| RENAULT SA 120126 FIX 0.0 | EUR | 4 000 000 | 3 997 053,24 | 0,04 |
| RENAULT SA 150126 FIX 0.0 | EUR | 2 500 000 | 2 497 698,16 | 0,03 |
| RENAULT SA 190126 FIX 0.0 | EUR | 4 500 000 | 4 494 752,86 | 0,05 |
| RENAULT SA 190326 FIX 0.0 | EUR | 10 000 000 | 9 951 904,93 | 0,10 |
| RENAULT SA 220126 FIX 0.0 | EUR | 11 000 000 | 10 985 151,19 | 0,11 |
| Banques commerciales | | | 2 888 273 007,60 | 29,77 |
| AFD ZCP 24-02-26 | EUR | 25 000 000 | 24 919 194,32 | 0,26 |
| AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT. 07052 | EUR | 21 000 000 | 20 840 657,49 | 0,21 |
| AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT. 13052 | EUR | 20 000 000 | 19 840 892,68 | 0,20 |



Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*) | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle | % Actif Net |
|--|--------|---------------------|-----------------|-------------|
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA 180526 | EUR | 50 000 000 | 49 602 336,42 | 0,51 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 19032 | EUR | 50 000 000 | 49 779 231,60 | 0,51 |
| BANKINTER, SA 091026 FIX 0.0 | EUR | 15 000 000 | 14 743 608,65 | 0,15 |
| BARCLAYS BANK PLC 061126 FIX 0.0 | EUR | 25 000 000 | 24 538 678,30 | 0,25 |
| BARCLAYS BANK PLC 201026 OISEST 0.34 | EUR | 15 000 000 | 15 078 641,94 | 0,16 |
| BNP PA OISEST+0.2% 19-02-26 | EUR | 50 000 000 | 50 402 629,47 | 0,52 |
| BNP PARIBAS 040526 OISEST 0.205 | EUR | 100 000 000 | 100 351 325,06 | 1,03 |
| BNP PARIBAS 160326 OISEST 0.22 | EUR | 80 000 000 | 80 524 783,11 | 0,83 |
| BPCE SA 040526 OISEST 0.22 | EUR | 100 000 000 | 100 356 847,58 | 1,03 |
| BPCE SA 100826 OISEST 0.3 | EUR | 25 000 000 | 25 085 209,77 | 0,26 |
| BPCE SA 300426 OISEST 0.21 | EUR | 50 000 000 | 50 187 819,07 | 0,52 |
| CFCM MAINE ANJOU B 050226 OISEST 0.23 | EUR | 30 000 000 | 30 270 663,07 | 0,31 |
| CFCM MAINE ANJOU B 110226 OISEST 0.24 | EUR | 30 000 000 | 30 261 729,03 | 0,31 |
| CFCM MAINE ANJOU B 140526 OISEST 0.25 | EUR | 30 000 000 | 30 087 472,29 | 0,31 |
| COMMERZBANK AG FRANCFORT 200326 FIX 0.0 | EUR | 38 500 000 | 38 329 211,95 | 0,39 |
| COMMONWEALTH B 290626 FIX 0.0 | EUR | 30 000 000 | 29 689 889,11 | 0,31 |
| CREDIT AGRICOLE SA 040526 OISEST 0.24 | EUR | 100 000 000 | 100 364 563,94 | 1,03 |
| CREDIT AGRICOLE SA 050526 OISEST 0.24 | EUR | 50 000 000 | 50 176 083,33 | 0,52 |
| CREDIT AGRICOLE SA 080526 OISEST 0.31 | EUR | 100 000 000 | 101 135 599,56 | 1,07 |
| CREDIT AGRICOLE SA 080626 OISEST 0.3 | EUR | 50 000 000 | 50 462 818,89 | 0,52 |
| CREDIT AGRICOLE SA 180326 OISEST 0.23 | EUR | 50 000 000 | 50 319 694,89 | 0,52 |
| CREDIT MUTUEL ARKEA 010726 OISEST 0.32 | EUR | 50 000 000 | 50 478 396,67 | 0,52 |
| CREDIT MUTUEL ARKEA 040526 OISEST 0.23 | EUR | 50 000 000 | 50 284 351,36 | 0,52 |
| CREDIT MUTUEL ARKEA 070726 OISEST 0.33 | EUR | 50 000 000 | 50 583 639,54 | 0,52 |
| CREDIT MUTUEL ARKEA 090426 OISEST 0.21 | EUR | 25 000 000 | 25 127 759,76 | 0,26 |
| CREDIT MUTUEL ARKEA 190626 OISEST 0.33 | EUR | 50 000 000 | 50 638 304,53 | 0,52 |
| CREDIT MUTUEL ARKEA 220626 OISEST 0.31 | EUR | 50 000 000 | 50 527 905,25 | 0,52 |
| CREDIT MUTUEL ARKEA 290126 OISEST 0.31 | EUR | 50 000 000 | 51 154 156,00 | 0,53 |
| CREDIT MUTUEL ARKEA 300326 OISEST 0.3 | EUR | 50 000 000 | 50 802 605,69 | 0,52 |
| ERSTE GROUP BANK AG 260326 FIX 0.0 | EUR | 12 500 000 | 12 440 393,07 | 0,13 |
| ERSTE GROUP BANK AG 300326 FIX 0.0 | EUR | 25 000 000 | 24 874 806,34 | 0,26 |
| ING BANK NEDERLAND NV 020426 OISEST 0.2 | EUR | 50 000 000 | 50 272 942,50 | 0,52 |
| INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG 050326 F | EUR | 50 000 000 | 49 821 484,09 | 0,51 |
| INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG 060526 F | EUR | 75 000 000 | 74 450 728,58 | 0,77 |
| INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG 140926 F | EUR | 25 000 000 | 24 613 761,07 | 0,25 |
| KBC GROUPE SA 260526 FIX 0.0 | EUR | 25 000 000 | 24 775 989,00 | 0,26 |
| KBC GROUPE ZCP 18-03-26 | EUR | 43 000 000 | 42 799 665,70 | 0,44 |
| LA BANQUE POSTALE. 010726 OISEST 0.25 | EUR | 50 000 000 | 50 038 760,75 | 0,52 |
| LA BANQUE POSTALE. 040526 OISEST 0.2 | EUR | 50 000 000 | 50 174 409,75 | 0,52 |
| LA BANQUE POSTALE. 100726 OISEST 0.305 | EUR | 50 000 000 | 50 551 334,24 | 0,52 |
| LA BANQUE POSTALE 270126 OISEST 0.3 | EUR | 50 000 000 | 51 156 748,67 | 0,53 |
| LA BANQUE POSTALE 270226 OISEST 0.275 | EUR | 50 000 000 | 50 907 957,50 | 0,52 |
| LCL CREDIT LYONNAIS 090426 OISEST 0.22 | EUR | 50 000 000 | 50 252 972,31 | 0,52 |
| LCL CREDIT LYONNAIS 120126 OISEST 0.26 | EUR | 50 000 000 | 50 619 678,06 | 0,52 |
| LCL CREDIT LYONNAIS 200426 OISEST 0.3 | EUR | 50 000 000 | 50 619 471,19 | 0,52 |
| LCL CREDIT LYONNAIS 220626 OISEST 0.3 | EUR | 50 000 000 | 50 420 419,00 | 0,52 |



Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*) | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle | % Actif Net |
|--|--------|---------------------|-----------------------|-------------|
| LCL CREDIT LYONNAIS 230226 OISEST 0.22 | EUR | 50 000 000 | 50 402 302,33 | 0,52 |
| LCL CREDIT LYONNAIS 230326 OISEST 0.22 | EUR | 50 000 000 | 50 301 682,00 | 0,52 |
| MUFG BANK, LTD., LONDON BRANCH 250326 FI | EUR | 25 000 000 | 24 879 645,54 | 0,26 |
| NATIONAL AUSTRALIA 260626 OISEST 0.25 | EUR | 70 000 000 | 70 815 176,29 | 0,73 |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD LONDON 301026 FIX 0.0 | EUR | 50 000 000 | 49 087 347,58 | 0,51 |
| NATIONAL BANK 130826 FIX 0.0 | EUR | 12 000 000 | 11 840 749,32 | 0,12 |
| NOMURA BANK INTERNATIONAL PLC. 260126 FI | EUR | 11 000 000 | 10 983 665,89 | 0,11 |
| RCI BANQUE 260226 FIX 0.0 | EUR | 17 000 000 | 16 943 563,39 | 0,17 |
| SANTANDER CONSUMER BANK 140426 FIX 0.0 | EUR | 10 000 000 | 9 938 032,61 | 0,10 |
| SANTANDER CONSUMER BANK 150726 FIX 0.0 | EUR | 7 000 000 | 6 916 191,66 | 0,07 |
| SANTANDER CONSUMER BANK 160726 FIX 0.0 | EUR | 9 000 000 | 8 891 674,43 | 0,09 |
| SANTANDER CONSUMER BANK 180926 FIX 0.0 | EUR | 25 000 000 | 24 595 452,16 | 0,25 |
| SOCIETE GENERALE 010726 OISEST 0.31 | EUR | 75 000 000 | 75 813 008,58 | 0,78 |
| SOCIETE GENERALE 060226 OISEST 0.2 | EUR | 50 000 000 | 50 440 366,17 | 0,52 |
| SOCIETE GENERALE 150526 OISEST 0.23 | EUR | 50 000 000 | 50 235 120,83 | 0,52 |
| SOCIETE GENERALE 310326 OISEST 0.3 | EUR | 50 000 000 | 50 650 267,25 | 0,52 |
| UNICREDIT S.P.A. 120326 FIX 0.0 | EUR | 50 000 000 | 49 800 539,43 | 0,51 |
| Biens de consommation durables | | | 32 973 202,56 | 0,34 |
| SEB SA 090126 FIX 0.0 | EUR | 6 000 000 | 5 996 769,39 | 0,06 |
| SEB SA 120126 FIX 0.0 | EUR | 17 000 000 | 16 987 795,97 | 0,18 |
| SEB SA 190126 FIX 0.0 | EUR | 10 000 000 | 9 988 637,20 | 0,10 |
| Boissons | | | 11 769 016,06 | 0,12 |
| COCA COLA HBC FINANCE BV 041126 FIX 0.0 | EUR | 12 000 000 | 11 769 016,06 | 0,12 |
| Composants automobiles | | | 50 881 619,99 | 0,52 |
| CONTINENTAL AG 300126 FIX 0.0 | EUR | 21 500 000 | 21 462 015,81 | 0,22 |
| OPMOBILITY 040226 FIX 0.0 | EUR | 7 500 000 | 7 482 256,24 | 0,08 |
| OPMOBILITY 060126 FIX 0.0 | EUR | 8 000 000 | 7 996 752,12 | 0,08 |
| OPMOBILITY 170326 FIX 0.0 | EUR | 4 000 000 | 3 979 496,97 | 0,04 |
| OPMOBILITY 210126 FIX 0.0 | EUR | 5 000 000 | 4 992 899,85 | 0,05 |
| VALEO SA 140426 FIX 0.0 | EUR | 5 000 000 | 4 968 199,00 | 0,05 |
| Construction et ingénierie | | | 50 716 402,27 | 0,52 |
| GROU E E3R+0.9% 05-02-27 | EUR | 24 400 000 | 24 600 833,69 | 0,25 |
| GROU E E3R+0.9% 17-12-26 | EUR | 26 000 000 | 26 115 568,58 | 0,27 |
| Crédit à la consommation | | | 124 050 063,58 | 1,28 |
| NTT FINANCE UK LIMITED 130326 FIX 0.0 | EUR | 68 000 000 | 67 700 493,02 | 0,70 |
| NTT FINANCE UK LIMITED 260226 FIX 0.0 | EUR | 16 500 000 | 16 442 343,14 | 0,17 |
| SANTANDER CONSUMER FINANCE S.A. 020226 F | EUR | 30 000 000 | 29 945 262,31 | 0,31 |
| SANTANDER CONSUMER FINANCE S.A. 090326 F | EUR | 10 000 000 | 9 961 965,11 | 0,10 |
| Distribution de produits alimentaires de première nécessité | | | 147 663 382,76 | 1,52 |
| CARREFOUR S A 110226 FIX 0.0 | EUR | 10 000 000 | 9 975 639,99 | 0,10 |
| CARREFOUR S A 160226 FIX 0.0 | EUR | 21 000 000 | 20 942 699,67 | 0,22 |
| CARREFOUR S A 170226 FIX 0.0 | EUR | 21 000 000 | 20 941 469,99 | 0,22 |
| CARREFOUR S A 220126 FIX 0.0 | EUR | 11 000 000 | 10 985 989,93 | 0,11 |
| REN R ENER NAC 2.13% 02-02-26 | EUR | 40 000 000 | 39 920 032,52 | 0,41 |



Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*) | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle | % Actif Net |
|--|--------|---------------------|-----------------------|-------------|
| SAVENCIA SA 190226 FIX 0.0 | EUR | 18 000 000 | 17 946 280,80 | 0,18 |
| SAVENCIA SA 300126 FIX 0.0 | EUR | 27 000 000 | 26 951 269,86 | 0,28 |
| Divertissement | | | 25 432 846,75 | 0,26 |
| VIVENDI 160226 FIX 0.0 | EUR | 6 500 000 | 6 481 873,44 | 0,07 |
| VIVENDI 200126 FIX 0.0 | EUR | 7 000 000 | 6 991 760,21 | 0,07 |
| VIVENDI 260226 FIX 0.0 | EUR | 12 000 000 | 11 959 213,10 | 0,12 |
| Electricité | | | 269 434 462,12 | 2,78 |
| EDF 020426 FIX 0.0 | EUR | 50 000 000 | 49 729 420,57 | 0,51 |
| EDF 130526 FIX 0.0 | EUR | 50 000 000 | 49 610 722,99 | 0,51 |
| EDF 240726 FIX 0.0 | EUR | 12 500 000 | 12 350 584,52 | 0,13 |
| EDF 310726 FIX 0.0 | EUR | 25 000 000 | 24 690 574,16 | 0,25 |
| EDF E3R+0.58% 22-01-27 | EUR | 30 000 000 | 30 187 945,00 | 0,31 |
| EDF E3R+0.6% 19-05-27 | EUR | 55 000 000 | 55 211 878,33 | 0,58 |
| SSE PLC. 110326 FIX 0.0 | EUR | 4 500 000 | 4 481 406,40 | 0,05 |
| SSE PLC. 160126 FIX 0.0 | EUR | 4 500 000 | 4 495 776,97 | 0,05 |
| SSE PLC. 280126 FIX 0.0 | EUR | 15 000 000 | 14 975 380,64 | 0,15 |
| SSE PLC. 290126 FIX 0.0 | EUR | 13 750 000 | 13 726 627,63 | 0,14 |
| SSE ZCP 13-02-26 | EUR | 10 000 000 | 9 974 144,91 | 0,10 |
| Emballage et conditionnement | | | 6 994 153,20 | 0,07 |
| VERALLIA SASU 140126 FIX 0.0 | EUR | 7 000 000 | 6 994 153,20 | 0,07 |
| Epargne et prêts hypothécaires | | | 50 482 862,01 | 0,52 |
| EUROFACTOR 270226 OISEST 0.26 | EUR | 50 000 000 | 50 482 862,01 | 0,52 |
| Equipements électriques | | | 57 382 514,82 | 0,59 |
| ALSTOM SA 020126 FIX 0.0 | EUR | 4 500 000 | 4 499 459,64 | 0,05 |
| ALSTOM SA 230126 FIX 0.0 | EUR | 10 000 000 | 9 986 206,28 | 0,10 |
| ALSTOM SA 290126 FIX 0.0 | EUR | 6 500 000 | 6 488 698,69 | 0,07 |
| ALSTOM SA 310326 FIX 0.0 | EUR | 9 000 000 | 8 951 347,19 | 0,09 |
| NEXANS SA 050226 FIX 0.0 | EUR | 2 500 000 | 2 494 479,22 | 0,03 |
| NEXANS SA 210126 FIX 0.0 | EUR | 3 000 000 | 2 996 134,16 | 0,03 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE 260126 FIX 0.0 | EUR | 22 000 000 | 21 966 189,64 | 0,22 |
| Equipements et instruments électroniques | | | 64 409 691,37 | 0,66 |
| IBERDROLA INTERNATIONAL BV 110226 FIX 0. | EUR | 25 000 000 | 24 938 081,24 | 0,25 |
| IBERDROLA INTERNATIONAL BV 170326 FIX 0. | EUR | 25 000 000 | 24 888 154,57 | 0,26 |
| LEGR F E3R+0.38% 06-10-27 | EUR | 14 500 000 | 14 583 455,56 | 0,15 |
| FPI Bureautiques | | | 53 045 222,01 | 0,55 |
| GECINA 130726 FIX 0.0 | EUR | 20 000 000 | 19 766 256,55 | 0,21 |
| GECINA 180626 FIX 0.0 | EUR | 20 000 000 | 19 800 293,96 | 0,20 |
| GECINA 280126 FIX 0.0 | EUR | 13 500 000 | 13 478 671,50 | 0,14 |
| FPI de détail | | | 154 199 790,47 | 1,59 |
| CARMILA SA 070426 FIX 0.0 | EUR | 8 000 000 | 7 953 310,99 | 0,08 |
| CARMILA SA 300126 FIX 0.0 | EUR | 9 000 000 | 8 983 935,97 | 0,09 |
| KLEPIERRE 070426 FIX 0.0 | EUR | 16 000 000 | 15 907 781,05 | 0,16 |
| KLEPIERRE 070526 FIX 0.0 | EUR | 10 000 000 | 9 924 153,88 | 0,10 |



Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*) | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle | % Actif Net |
|--|--------|---------------------|-----------------------|-------------|
| KLEPIERRE 080426 FIX 0.0 | EUR | 7 000 000 | 6 959 231,28 | 0,07 |
| KLEPIERRE 090326 FIX 0.0 | EUR | 22 000 000 | 21 911 528,07 | 0,25 |
| KLEPIERRE 120326 FIX 0.0 | EUR | 10 000 000 | 9 957 991,38 | 0,10 |
| KLEPIERRE 160126 FIX 0.0 | EUR | 5 000 000 | 4 995 297,32 | 0,05 |
| KLEPIERRE 160326 FIX 0.0 | EUR | 20 000 000 | 19 911 191,94 | 0,21 |
| KLEPIERRE 220126 FIX 0.0 | EUR | 8 000 000 | 7 989 657,26 | 0,08 |
| KLEPIERRE 230326 FIX 0.0 | EUR | 12 000 000 | 11 941 674,01 | 0,12 |
| KLEPIERRE 260626 FIX 0.0 | EUR | 10 000 000 | 9 893 380,60 | 0,10 |
| KLEPIERRE 270226 FIX 0.0 | EUR | 6 000 000 | 5 979 453,53 | 0,06 |
| KLEPIERRE 290726 FIX 0.0 | EUR | 8 000 000 | 7 898 252,08 | 0,08 |
| KLEPIERRE 300126 FIX 0.0 | EUR | 4 000 000 | 3 992 951,11 | 0,04 |
| FPI Soins de Santé | | | 37 902 883,04 | 0,39 |
| COFINIMMO SA 170326 FIX 0.0 | EUR | 15 000 000 | 14 931 057,01 | 0,16 |
| COFINIMMO SA 190126 FIX 0.0 | EUR | 13 000 000 | 12 985 097,62 | 0,13 |
| COFINIMMO SA 220126 FIX 0.0 | EUR | 10 000 000 | 9 986 728,41 | 0,10 |
| Gestion et promotion immobilière | | | 69 590 742,73 | 0,72 |
| CDC HABITAT 041226 FIX 0.0 | EUR | 7 500 000 | 7 342 099,42 | 0,08 |
| CDC HABITAT 050126 FIX 0.0 | EUR | 10 000 000 | 9 997 100,84 | 0,10 |
| CDC HABITAT 090226 FIX 0.0 | EUR | 20 000 000 | 19 953 649,89 | 0,21 |
| CDC HABITAT 160326 FIX 0.0 | EUR | 7 500 000 | 7 467 042,34 | 0,08 |
| CDC HABITAT 260226 FIX 0.0 | EUR | 20 000 000 | 19 933 924,85 | 0,20 |
| CDC HABITAT ZCP 27-11-26 | EUR | 5 000 000 | 4 896 925,39 | 0,05 |
| Hôtels, restaurants et loisirs | | | 7 994 442,26 | 0,08 |
| ACCOR SA 120126 FIX 0.0 | EUR | 8 000 000 | 7 994 442,26 | 0,08 |
| Industrie aérospatiale et défense | | | 56 896 197,43 | 0,59 |
| SAFRAN SA 130226 FIX 0.0 | EUR | 14 000 000 | 13 963 673,50 | 0,14 |
| SAFRAN SA 160126 FIX 0.0 | EUR | 13 000 000 | 12 987 668,06 | 0,13 |
| SAFRAN SA 160226 FIX 0.0 | EUR | 13 000 000 | 12 964 003,43 | 0,13 |
| SAFRAN SA 190126 FIX 0.0 | EUR | 17 000 000 | 16 980 852,44 | 0,19 |
| Infrastructure de transports | | | 17 446 351,32 | 0,18 |
| ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA 050326 FIX 0 | EUR | 2 500 000 | 2 490 560,22 | 0,03 |
| ABERTIS INFRASTRUCTURAS SA 190226 FIX 0 | EUR | 15 000 000 | 14 955 791,10 | 0,15 |
| Logiciels | | | 24 991 024,47 | 0,26 |
| VINCI SA 060126 FIX 0.0 | EUR | 25 000 000 | 24 991 024,47 | 0,26 |
| Machines | | | 26 888 840,57 | 0,28 |
| STANLEY BLACK DECKER INC 190326 FIX 0.0 | EUR | 21 000 000 | 20 899 216,66 | 0,22 |
| STANLEY BLACK DECKER INC 280126 FIX 0.0 | EUR | 6 000 000 | 5 989 623,91 | 0,06 |
| Marchés de capitaux | | | 175 968 356,39 | 1,81 |
| ABN AMRO BANK NV 060526 FIX 0.0 | EUR | 50 000 000 | 49 635 164,17 | 0,51 |
| ABN AMRO BANK NV 070426 FIX 0.0 | EUR | 50 000 000 | 49 720 153,84 | 0,51 |
| BANCO SANTANDER (ALL SPAIN BR) 230426 | EUR | 30 000 000 | 29 804 920,50 | 0,31 |
| MOHAWK CAPITAL LUXEMBOURG SA 050126 FIX | EUR | 4 000 000 | 3 998 788,37 | 0,04 |
| MOHAWK CAPITAL LUXEMBOURG SA 090126 FIX | EUR | 13 000 000 | 12 992 913,34 | 0,13 |



Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*) | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle | % Actif Net |
|--|--------|---------------------|-----------------------|-------------|
| MOHAWK CAPITAL LUXEMBOURG SA 190126 FIX | EUR | 5 000 000 | 4 994 248,04 | 0,05 |
| NORDEA BANK ABP. 050526 FIX 0.0 | EUR | 25 000 000 | 24 822 168,13 | 0,26 |
| Médias | | | 10 000 000,00 | 0,10 |
| HAVAS SA 311225 FIX 0.0 | EUR | 10 000 000 | 10 000 000,00 | 0,10 |
| Outils et services appliqués aux sciences biologiques | | | 56 936 685,61 | 0,59 |
| DANAHER CORP 150126 FIX 0.0 | EUR | 11 500 000 | 11 489 620,56 | 0,12 |
| DANAHER CORP 220126 FIX 0.0 | EUR | 16 000 000 | 15 978 827,88 | 0,16 |
| EURO SCIE SE ZCP 16-01-26 | EUR | 29 500 000 | 29 468 237,17 | 0,31 |
| Produits alimentaires | | | 62 931 653,08 | 0,65 |
| BEL SA 120126 FIX 0.0 | EUR | 3 000 000 | 2 997 896,08 | 0,03 |
| BEL SA 130126 FIX 0.0 | EUR | 4 500 000 | 4 496 581,16 | 0,05 |
| BEL SA 190226 FIX 0.0 | EUR | 5 000 000 | 4 985 285,79 | 0,05 |
| BONDUELLE 230326 FIX 0.0 | EUR | 5 500 000 | 5 469 993,95 | 0,06 |
| BONDUELLE 300326 FIX 0.0 | EUR | 2 000 000 | 1 988 064,08 | 0,02 |
| BONDUELLE 311225 FIX 0.0 | EUR | 7 100 000 | 7 100 000,00 | 0,07 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC 110226 FIX 0. | EUR | 6 000 000 | 5 984 464,63 | 0,06 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC 180226 FIX 0. | EUR | 30 000 000 | 29 909 367,39 | 0,31 |
| Produits pharmaceutiques | | | 13 980 667,52 | 0,14 |
| NOVO NORDISK A/S 140126 FIX 0.0 | EUR | 7 500 000 | 7 492 972,17 | 0,07 |
| NOVO NORDISK A/S 290126 FIX 0.0 | EUR | 2 000 000 | 1 996 121,54 | 0,02 |
| NOVO NORDISK AS ZCP 28-01-26 | EUR | 4 500 000 | 4 491 573,81 | 0,05 |
| Services aux collectivités | | | 293 520 323,86 | 3,02 |
| AGENCE CENTRAL 060226 FIX 0.0 | EUR | 50 000 000 | 49 896 112,69 | 0,51 |
| ENGIE SA 050126 FIX 0.0 | EUR | 25 000 000 | 24 992 680,96 | 0,26 |
| ENGIE SA 070126 FIX 0.0 | EUR | 50 000 000 | 49 979 510,07 | 0,51 |
| ENGIE SA 120126 FIX 0.0 | EUR | 50 000 000 | 49 964 876,36 | 0,51 |
| EWE AG 150126 FIX 0.0 | EUR | 9 000 000 | 8 992 083,22 | 0,09 |
| EWE AG 190226 FIX 0.0 | EUR | 10 000 000 | 9 970 469,41 | 0,10 |
| FRAN TREA BILL BTF ZCP 18-02-26 | EUR | 100 000 000 | 99 724 591,15 | 1,04 |
| Services aux entreprises | | | 136 465 482,94 | 1,41 |
| ELIS SA EX HOLDELIS SA 200226 FIX 0.0 | EUR | 5 000 000 | 4 984 211,68 | 0,05 |
| ITAL BUON ORDI DEL ZCP 30-01-26 | EUR | 100 000 000 | 99 853 548,13 | 1,04 |
| LA POSTE 260126 FIX 0.0 | EUR | 16 000 000 | 15 976 739,02 | 0,16 |
| LA POSTE 280126 FIX 0.0 | EUR | 8 000 000 | 7 987 475,64 | 0,08 |
| SOCIETE BIC 200226 FIX 0.0 | EUR | 2 700 000 | 2 691 439,72 | 0,03 |
| SOCIETE BIC 300326 FIX 0.0 | EUR | 5 000 000 | 4 972 068,75 | 0,05 |
| Services aux professionnels | | | 7 995 610,81 | 0,08 |
| TELEPERFORMANCE SE 090126 FIX 0.0 | EUR | 8 000 000 | 7 995 610,81 | 0,08 |
| Services clientèle divers | | | 2 399 678,48 | 0,02 |
| ITT INDUSTRIES LUXEMBOURG SARL 020126 FI | EUR | 2 400 000 | 2 399 678,48 | 0,02 |
| Services de télécommunication diversifiés | | | 86 785 842,60 | 0,89 |
| TELEFONICA EUROPE BV 020426 FIX 0.0 | EUR | 32 000 000 | 31 826 942,42 | 0,33 |



Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*) | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle | % Actif Net |
|---|--------|---------------------|-----------------------|-------------|
| TELEFONICA EUROPE BV 080126 FIX 0.0 | EUR | 8 000 000 | 7 996 247,09 | 0,08 |
| TELSTRA GROUP LTD 300126 FIX 0.0 | USD | 32 500 000 | 27 528 913,29 | 0,28 |
| TELUS CORP 030326 FIX 0.0 | USD | 10 250 000 | 8 649 455,51 | 0,09 |
| TELUS CORP 090326 FIX 0.0 | USD | 6 250 000 | 5 270 461,31 | 0,05 |
| TELUS CORP 160126 FIX 0.0 | USD | 6 500 000 | 5 513 822,98 | 0,06 |
| Services de télécommunication mobile | | | 41 888 152,95 | 0,43 |
| AMERICA MOVIL BV 060226 FIX 0.0 | EUR | 17 500 000 | 17 460 256,62 | 0,18 |
| AMERICA MOVIL BV 130226 FIX 0.0 | EUR | 11 000 000 | 10 970 256,83 | 0,11 |
| AMERICA MOVIL BV 200226 FIX 0.0 | EUR | 13 500 000 | 13 457 639,50 | 0,14 |
| Services financiers diversifiés | | | 482 471 117,61 | 4,97 |
| AMCOR UK FINANCE PLC 080126 FIX 0.0 | EUR | 15 000 000 | 14 992 862,06 | 0,15 |
| AMCOR UK FINANCE PLC 120126 FIX 0.0 | EUR | 10 500 000 | 10 492 505,55 | 0,11 |
| AMCOR UK FINANCE PLC 130226 FIX 0.0 | EUR | 3 000 000 | 2 992 169,79 | 0,03 |
| AMCOR UK FINANCE PLC 140126 FIX 0.0 | EUR | 14 000 000 | 13 988 342,81 | 0,14 |
| AVERY DENNISON 160326 FIX 0.0 | EUR | 9 000 000 | 8 959 939,74 | 0,09 |
| AVERY DENNISON 311225 FIX 0.0 | EUR | 4 000 000 | 4 000 000,00 | 0,04 |
| AVRIL SCA 190326 FIX 0.0 | EUR | 8 000 000 | 7 957 755,86 | 0,08 |
| BANQUE STELLANTIS FRANCE 140426 FIX 0.0 | EUR | 25 000 000 | 24 848 577,19 | 0,26 |
| ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 150126 FIX | EUR | 44 000 000 | 43 960 951,68 | 0,45 |
| ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 311225 FIX 0.0 | EUR | 15 000 000 | 15 000 000,00 | 0,15 |
| LA DIFFUSION I 130326 FIX 0.0 | EUR | 5 000 000 | 4 976 970,56 | 0,05 |
| MEDIOBANCA INTERNATIONAL LTD 150526 FIX 0.0 | EUR | 20 000 000 | 19 846 521,88 | 0,20 |
| NATIXIS 070426 OISEST 0.33 | EUR | 50 000 000 | 50 788 608,29 | 0,52 |
| SGS FINANCE B.V. 230326 FIX 0.0 | EUR | 17 000 000 | 16 909 644,35 | 0,17 |
| SUMITOMO ELECTRIC FINANCE UK PLC 260126 | EUR | 65 000 000 | 64 899 179,13 | 0,70 |
| SUMITOMO MITSU 300326 FIX 0.0 | EUR | 25 000 000 | 24 870 505,56 | 0,26 |
| THE TORONTO-DO 130426 FIX 0.0 | EUR | 50 000 000 | 49 697 745,08 | 0,51 |
| THE TORONTO-DO 280926 FIX 0.0 | EUR | 25 000 000 | 24 593 081,51 | 0,25 |
| THE TORONTO-DO 300326 FIX 0.0 | EUR | 25 000 000 | 24 869 374,03 | 0,26 |
| VOLKSWAGEN FINANS SVERIGE AB 230126 FIX | SEK | 110 000 000 | 10 149 931,68 | 0,10 |
| VOLKSWAGEN FINANS SVERIGE AB 230326 FIX | SEK | 150 000 000 | 13 792 563,46 | 0,14 |
| VOLKSWAGEN FINANS SVERIGE AB 230326 FIX | SEK | 325 000 000 | 29 883 887,40 | 0,31 |
| Sociétés d'investissement immobilier cotées (SIIC) | | | 39 365 298,53 | 0,41 |
| COVIVIO SA 030226 FIX 0.0 | EUR | 12 000 000 | 11 976 418,70 | 0,12 |
| COVIVIO SA 240326 FIX 0.0 | EUR | 22 500 000 | 22 390 657,53 | 0,24 |
| ICADE PROMOTION 060126 FIX 0.0 | EUR | 5 000 000 | 4 998 222,30 | 0,05 |
| Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé | | | 354 545 372,70 | 3,65 |
| Automobiles | | | 44 180 951,23 | 0,46 |
| Gene Moto Fina Co ZCP 17-04-26 | USD | 10 000 000 | 8 395 034,44 | 0,09 |
| Gene Moto Fina Co ZCP 27-04-26 | USD | 10 000 000 | 8 385 459,24 | 0,09 |
| Gene Moto Fina Co ZCP 28-04-26 | USD | 15 000 000 | 12 576 756,95 | 0,13 |
| Gene Moto Fina Co ZCP 29-01-26 | USD | 17 500 000 | 14 823 700,60 | 0,15 |
| Banques commerciales | | | 134 301 553,33 | 1,38 |
| INTE BANK LUXE ZCP 10-07-26 | EUR | 50 000 000 | 49 431 806,78 | 0,51 |



Inventaire des éléments de bilan

| Désignation des valeurs par secteur d'activité (*) | Devise | Quantité ou Nominal | Valeur actuelle | % Actif Net |
|--|--------|---------------------|-------------------------|--------------|
| SANTANDER CONSUMER BANK 170226 FIX 0.0 | EUR | 10 000 000 | 9 972 291,66 | 0,10 |
| UNICREDIT S.P.A. 100226 OIEST 0.3 | EUR | 25 000 000 | 25 547 335,24 | 0,26 |
| UNICREDIT S.P.A. 110826 FIX 0.0 | EUR | 50 000 000 | 49 350 119,65 | 0,51 |
| Boissons | | | 16 382 798,45 | 0,17 |
| COCA COLA HBC FINANCE BV 190826 FIX 0.0 | EUR | 3 500 000 | 3 450 118,08 | 0,04 |
| COCA COLA HBC FINANCE BV 270326 FIX 0.0 | EUR | 13 000 000 | 12 932 680,37 | 0,13 |
| Crédit à la consommation | | | 14 955 101,75 | 0,15 |
| NTT FINANCE UK LIMITED 180226 FIX 0.0 | EUR | 15 000 000 | 14 955 101,75 | 0,15 |
| Electricité | | | 14 481 334,20 | 0,15 |
| TERNA RETE ELETTRICA NAZIONALE 220126 FIX 0.0 | EUR | 14 500 000 | 14 481 334,20 | 0,15 |
| Infrastructure de transports | | | 9 491 603,89 | 0,10 |
| ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 150126 FIX 0 | EUR | 9 500 000 | 9 491 603,89 | 0,10 |
| Marchés de capitaux | | | 47 820 214,23 | 0,49 |
| BANCO SANTANDER (ALL SPAIN BRANCH) 03032 | EUR | 23 000 000 | 22 920 321,96 | 0,24 |
| ENEL FINA AMER LLC ZCP 06-02-26 | USD | 20 000 000 | 16 928 557,19 | 0,17 |
| PALA MONE STAN ZCP 27-02-26 | EUR | 8 000 000 | 7 971 335,08 | 0,08 |
| Services clientèle divers | | | 4 496 744,51 | 0,05 |
| ISS GLOBAL AS 120126 FIX 0.0 | EUR | 4 500 000 | 4 496 744,51 | 0,05 |
| Services de télécommunication diversifiés | | | 50 499 567,18 | 0,52 |
| TELEFONICA EUROPE BV 020126 FIX 0.0 | EUR | 28 000 000 | 27 996 714,27 | 0,29 |
| TELEFONICA EUROPE BV 030626 FIX 0.0 | EUR | 10 000 000 | 9 908 349,36 | 0,10 |
| TELUS CORP 070426 FIX 0.0 | USD | 10 000 000 | 8 404 968,13 | 0,09 |
| TELUS ZCP 04-05-26 | USD | 5 000 000 | 4 189 535,42 | 0,04 |
| Services financiers diversifiés | | | 17 935 503,93 | 0,18 |
| NALCO OVERSEAS HOLDING BV 270226 FIX 0.0 | EUR | 18 000 000 | 17 935 503,93 | 0,18 |
| TITRES D'OPC | | | 946 287 232,37 | 9,75 |
| OPCVM | | | 946 287 232,37 | 9,75 |
| Gestion collective | | | 946 287 232,37 | 9,75 |
| OSTRUM EURO LIQUIDITY LVNAV SI | EUR | 600 | 151 564 884,00 | 1,56 |
| OSTRUM SRI CASH Part M | EUR | 16 830 | 181 544 200,20 | 1,87 |
| OSTRUM SRI CASH PLUS SI | EUR | 962 | 250 268 253,82 | 2,58 |
| OSTRUM SRI MONEY 6M PART SIC | EUR | 520 | 132 491 444,80 | 1,37 |
| OSTRUM SRI MONEY PLUS SI | EUR | 885 | 230 418 449,55 | 2,37 |
| Total | | | 9 232 868 589,58 | 95,13 |

(*) 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 (*) |
| V/SEK/EUR/20260123 | 0,00 | -125 394,59 | EUR | 10 032 911,19 | SEK | -10 158 305,78 |
| V/SEK/EUR/20260323 | 0,00 | -117 345,94 | EUR | 13 693 677,67 | SEK | -13 811 023,61 |
| V/SEK/EUR/20260323 | 0,00 | -244 812,90 | EUR | 29 679 071,60 | SEK | -29 923 884,50 |
| V/USD/EUR/20260116 | 0,00 | -3 984,14 | EUR | 5 510 378,28 | USD | -5 514 362,42 |
| V/USD/EUR/20260129 | 79 617,64 | 0,00 | EUR | 14 906 802,45 | USD | -14 827 184,81 |
| V/USD/EUR/20260130 | 0,00 | -54 647,25 | EUR | 27 478 899,28 | USD | -27 533 546,53 |
| V/USD/EUR/20260206 | 348 064,32 | 0,00 | EUR | 17 279 538,51 | USD | -16 931 474,19 |
| V/USD/EUR/20260303 | 25 993,86 | 0,00 | EUR | 8 680 597,67 | USD | -8 654 603,81 |
| V/USD/EUR/20260309 | 113 929,79 | 0,00 | EUR | 5 387 826,55 | USD | -5 273 896,76 |
| V/USD/EUR/20260310 | 173 905,47 | 0,00 | EUR | 10 720 597,53 | USD | -10 546 692,06 |
| V/USD/EUR/20260407 | 176 763,15 | 0,00 | EUR | 8 589 497,47 | USD | -8 412 734,32 |
| V/USD/EUR/20260417 | 79 582,94 | 0,00 | EUR | 8 483 658,47 | USD | -8 404 075,53 |
| V/USD/EUR/20260427 | 59 949,83 | 0,00 | EUR | 8 455 380,66 | USD | -8 395 430,83 |
| V/USD/EUR/20260428 | 88 978,94 | 0,00 | EUR | 12 680 829,64 | USD | -12 591 850,70 |
| V/USD/EUR/20260504 | 78 711,29 | 0,00 | EUR | 4 273 314,03 | USD | -4 194 602,74 |
| Total | 1 225 497,23 | -546 184,82 | | 185 852 981,00 | | -185 173 668,59 |

(*) 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/1.8113/OISEST/0. | 15 000 000 | 0,00 | -9 886,34 | 15 000 000,00 |
| FIX/1.8328/OISEST/0. | 15 000 000 | 0,00 | -13 812,19 | 15 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.693 | 30 000 000 | 85 965,43 | 0,00 | 30 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.734 | 12 500 000 | 25 672,54 | 0,00 | 12 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.750 | 30 000 000 | 57 402,26 | 0,00 | 30 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.758 | 50 000 000 | 91 272,98 | 0,00 | 50 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.763 | 9 000 000 | 15 977,81 | 0,00 | 9 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.768 | 10 000 000 | 17 352,77 | 0,00 | 10 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.770 | 12 000 000 | 14 260,80 | 0,00 | 12 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.772 | 7 000 000 | 11 796,54 | 0,00 | 7 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.782 | 7 500 000 | 9 020,32 | 0,00 | 7 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.794 | 50 000 000 | 55 760,83 | 0,00 | 50 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.796 | 13 000 000 | 14 292,60 | 0,00 | 13 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.807 | 6 000 000 | 6 762,48 | 0,00 | 6 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.808 | 4 000 000 | 3 090,08 | 0,00 | 4 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.809 | 11 000 000 | 7 262,20 | 0,00 | 11 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.812 | 16 000 000 | 10 296,19 | 0,00 | 16 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.812 | 21 000 000 | 15 848,42 | 0,00 | 21 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.812 | 25 000 000 | 31 769,66 | 0,00 | 25 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.815 | 10 000 000 | 7 379,46 | 0,00 | 10 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.815 | 10 000 000 | 7 390,90 | 0,00 | 10 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.816 | 13 500 000 | 8 658,47 | 0,00 | 13 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.818 | 8 000 000 | 9 698,26 | 0,00 | 8 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.819 | 6 143 000 | 6 715,70 | 0,00 | 6 143 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.823 | 21 000 000 | 14 534,43 | 0,00 | 21 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.824 | 8 500 000 | 5 234,10 | 0,00 | 8 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.824 | 8 000 000 | 4 605,01 | 0,00 | 8 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.825 | 13 000 000 | 7 932,14 | 0,00 | 13 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.828 | 50 000 000 | 27 632,04 | 0,00 | 50 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.831 | 9 500 000 | 5 040,21 | 0,00 | 9 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.831 | 8 000 000 | 4 333,64 | 0,00 | 8 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.833 | 12 000 000 | 12 542,77 | 0,00 | 12 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.833 | 7 000 000 | 3 685,63 | 0,00 | 7 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.837 | 25 000 000 | 12 659,77 | 0,00 | 25 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.838 | 20 000 000 | 24 995,11 | 0,00 | 20 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.838 | 28 000 000 | 13 944,36 | 0,00 | 28 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.855 | 25 000 000 | 20 058,68 | 0,00 | 25 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.863 | 50 000 000 | 22 301,97 | 0,00 | 50 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.864 | 43 000 000 | 18 892,05 | 0,00 | 43 000 000,00 |



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/1.868 | 5 000 000 | 2 094,64 | 0,00 | 5 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.873 | 50 000 000 | 29 925,73 | 0,00 | 50 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.876 | 15 000 000 | 8 651,07 | 0,00 | 15 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.879 | 14 000 000 | 4 160,88 | 0,00 | 14 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.880 | 25 000 000 | 13 880,24 | 0,00 | 25 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.881 | 12 000 000 | 6 204,27 | 0,00 | 12 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.881 | 5 000 000 | 1 442,22 | 0,00 | 5 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.881 | 25 000 000 | 12 782,13 | 0,00 | 25 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.882 | 13 000 000 | 3 743,57 | 0,00 | 13 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.884 | 25 000 000 | 7 305,16 | 0,00 | 25 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.887 | 20 000 000 | 20 195,74 | 0,00 | 20 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.888 | 22 000 000 | 5 550,53 | 0,00 | 22 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.888 | 5 000 000 | 2 226,54 | 0,00 | 5 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.889 | 11 000 000 | 2 168,22 | 0,00 | 11 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.890 | 10 000 000 | 2 401,05 | 0,00 | 10 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.890 | 20 000 000 | 4 861,89 | 0,00 | 20 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.890 | 17 000 000 | 4 179,60 | 0,00 | 17 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.891 | 25 000 000 | 10 824,86 | 0,00 | 25 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.892 | 20 000 000 | 4 647,50 | 0,00 | 20 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.897 | 50 000 000 | 12 934,54 | 0,00 | 50 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.901 | 7 500 000 | 2 489,09 | 0,00 | 7 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.905 | 7 500 000 | 2 053,01 | 0,00 | 7 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.906 | 4 062 000 | 1 079,37 | 0,00 | 4 062 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.907 | 9 000 000 | 1 469,00 | 0,00 | 9 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.909 | 10 000 000 | 1 418,55 | 0,00 | 10 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.910 | 50 000 000 | 6 323,26 | 0,00 | 50 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.910 | 25 000 000 | 3 161,63 | 0,00 | 25 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.910 | 50 000 000 | 6 867,18 | 0,00 | 50 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.911 | 50 000 000 | 6 185,07 | 0,00 | 50 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.911 | 21 000 000 | 2 546,99 | 0,00 | 21 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.911 | 20 000 000 | 2 396,80 | 0,00 | 20 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.912 | 12 000 000 | 1 556,58 | 0,00 | 12 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.916 | 7 000 000 | 775,30 | 0,00 | 7 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.916 | 32 000 000 | 3 491,20 | 0,00 | 32 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.916 | 25 000 000 | 2 738,56 | 0,00 | 25 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.917 | 12 500 000 | 1 304,00 | 0,00 | 12 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.918 | 25 000 000 | 2 538,40 | 0,00 | 25 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.918 | 10 000 000 | 1 007,10 | 0,00 | 10 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.918 | 50 000 000 | 4 940,13 | 0,00 | 50 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.919 | 6 000 000 | 579,65 | 0,00 | 6 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.920 | 25 000 000 | 2 226,94 | 0,00 | 25 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.973 | 7 500 000 | 2 613,13 | 0,00 | 7 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.974 | 10 000 000 | 3 217,06 | 0,00 | 10 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.977 | 22 500 000 | 8 235,99 | 0,00 | 22 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/1.977 | 50 000 000 | 14 402,00 | 0,00 | 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/1.980 | 7 950 000 | 2 260,45 | 0,00 | 7 950 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.013 | 10 000 000 | 0,00 | -449,16 | 10 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.018 | 10 000 000 | 0,00 | -844,37 | 10 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.022 | 5 000 000 | 0,00 | -4 302,27 | 5 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.024 | 6 000 000 | 0,00 | -793,62 | 6 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.025 | 8 000 000 | 0,00 | -1 136,72 | 8 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.026 | 7 000 000 | 0,00 | -6 558,74 | 7 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.034 | 10 000 000 | 0,00 | -1 176,27 | 10 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.039 | 23 000 000 | 3 092,78 | 0,00 | 23 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.041 | 50 000 000 | 3 883,33 | 0,00 | 50 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.046 | 13 500 000 | 0,00 | -11 809,31 | 13 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.048 | 5 000 000 | 1 840,54 | 0,00 | 5 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.051 | 10 000 000 | 0,00 | -11 834,44 | 10 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.054 | 7 000 000 | 0,00 | -1 768,33 | 7 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.059 | 8 500 000 | 0,00 | -2 131,18 | 8 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.060 | 10 000 000 | 0,00 | -4 574,54 | 10 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.065 | 10 000 000 | 0,00 | -4 710,65 | 10 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.067 | 8 000 000 | 0,00 | -13 587,68 | 8 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.068 | 13 000 000 | 0,00 | -6 755,45 | 13 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.069 | 6 000 000 | 0,00 | -7 657,86 | 6 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.079 | 5 000 000 | 0,00 | -6 907,85 | 5 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.094 | 3 500 000 | 0,00 | -5 369,36 | 3 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.103 | 38 500 000 | 0,00 | -30 689,79 | 38 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.104 | 25 000 000 | 0,00 | -7 751,12 | 25 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.104 | 10 000 000 | 0,00 | -9 465,62 | 10 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.109 | 5 000 000 | 0,00 | -8 423,43 | 5 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.118 | 6 000 000 | 0,00 | -4 289,26 | 6 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.124 | 5 000 000 | 0,00 | -7 800,00 | 5 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.129 | 14 800 000 | 0,00 | -20 516,09 | 14 800 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.154 | 50 000 000 | 0,00 | -42 835,97 | 50 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.170 | 7 000 000 | 0,00 | -14 210,00 | 7 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.172 | 4 500 000 | 0,00 | -6 461,75 | 4 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.181 | 7 500 000 | 0,00 | -3 927,44 | 7 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.192 | 13 100 000 | 0,00 | -41 011,26 | 13 100 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.220 | 10 000 000 | 0,00 | -34 044,59 | 10 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.224 | 8 000 000 | 0,00 | -3 386,81 | 8 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.258 | 7 347 000 | 0,00 | -4 860,69 | 7 347 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.271 | 6 000 000 | 0,00 | -18 525,30 | 6 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.287 | 5 000 000 | 0,00 | -6 392,25 | 5 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.316 | 7 500 000 | 0,00 | -14 172,96 | 7 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.324 | 5 563 000 | 0,00 | -2 320,52 | 5 563 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.930 | 5 000 000 | 0,00 | -41 327,08 | 5 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/2.998 | 10 000 000 | 0,00 | -89 536,38 | 10 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/3.001 | 13 500 000 | 0,00 | -114 620,07 | 13 500 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/3.019 | 16 000 000 | 0,00 | -148 002,97 | 16 000 000,00 |

**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/3.054 | 15 000 000 | 0,00 | -137 046,88 | 15 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/3.055 | 8 000 000 | 0,00 | -73 130,00 | 8 000 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/3.106 | 8 900 000 | 0,00 | -85 998,84 | 8 900 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/3.110 | 4 200 000 | 0,00 | -46 534,00 | 4 200 000,00 |
| OISEST/0.0/FIX/3.115 | 6 500 000 | 0,00 | -62 678,50 | 6 500 000,00 |
| Sous-total 3. | | 968 912,08 | -1 196 025,90 | 2 216 565 000,00 |
| 4. Autres instruments | | | | |
| Sous-total 4. | | 0,00 | 0,00 | 0,00 |
| Total | | 968 912,08 | -1 196 025,90 | 2 216 565 000,00 |

(*) 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) | 9 232 868 589,58 |
| Inventaire des IFT (hors IFT utilisés en couverture de parts émises) : | |
| Total opérations à terme de devises | 679 312,41 |
| Total instruments financiers à terme - actions | 0,00 |
| Total instruments financiers à terme - taux | -227 113,82 |
| 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 (+) | 476 569 224,07 |
| Autres passifs (-) | -4 519 233,41 |
| Passifs de financement (-) | 0,00 |
| Total = actif net | 9 705 370 778,83 |

| Libellé de la part | Devise de la part | Nombre de parts | Valeur liquidative |
|----------------------------|-------------------|-----------------|--------------------|
| Part OSTRUM SRI MONEY I1 | EUR | 42 737,04746 | 410,368 |
| Part OSTRUM SRI MONEY I C | EUR | 445 106,13270 | 13 571,22 |
| Part OSTRUM SRI MONEY I-D | EUR | 1 784,65381 | 12 123,81 |
| Part OSTRUM SRI MONEY N | EUR | 7 643,27535 | 108,37 |
| Part OSTRUM SRI MONEY R | EUR | 256 784,57440 | 10 803,45 |
| Part OSTRUM SRI MONEY R1 | EUR | 959 882,04035 | 130,973 |
| Part OSTRUM SRI MONEY RE C | EUR | 66 183,01275 | 10 813,89 |
| Part OSTRUM SRI MONEY T C | EUR | 847,58886 | 10 803,06 |



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