



**NATIXIS INVESTMENT
MANAGERS INTERNATIONAL**

OICVM de derecho francés

OSTRUM SRI MONEY

INFORME SEMESTRAL

a 29 de diciembre de 2022

Sociedad Gestora: Natixis Investment Managers International

Depositario: CACEIS Bank

Auditor: Mazars



• ESTADO DEL PATRIMONIO EN EUR

Elementos del estado del patrimonio	Importe de asignación periódica*
a) Títulos financieros elegibles contemplados en el apartado I.1º del artículo L. 214-20 del código monetario y financiero francés (<i>Code monétaire et financier</i>).	8 560 839 268,53
b) Activos bancarios	969 030 808,43
c) Otros activos mantenidos por el OIC	1 018 251 341,37
d) Total de activos mantenidos por el OIC (líneas a+b+c)	10 548 121 418,33
e) Pasivo	-9 658 713,65
f) Valor liquidativo (líneas d+e = patrimonio neto del OIC)	10 538 462 704,68

* Los importes se han acordado

• NÚMERO DE PARTICIPACIONES EN CIRCULACIÓN Y VALOR LIQUIDATIVO POR PARTICIPACIÓN

Participación	Tipo de participación	Patrimonio neto por participación	Número de participaciones en circulación	Valor liquidativo por participación
OSTRUM SRI MONEY I C en EUR	C	9 565 847 828,76	774 621,38141	12 349,06
OSTRUM SRI MONEY I-D en EUR	D	55 771 840,76	4643,56955	12 010,55
OSTRUM SRI MONEY Participación I 1 en EUR	C/D	11 907 023,83	31 884,89548	373,437
OSTRUM SRI MONEY Participación R 1 en EUR	C/D	15 738 741,01	131 948,25842	119,279
OSTRUM SRI MONEY R en EUR	C	249 608 001,49	25 327,33879	9855,27
OSTRUM SRI MONEY RE C en EUR	C	628 786 305,33	63 738,13584	9865,15
OSTRUM SRI MONEY T C en EUR	C	10 802 963,50	1096,12059	9855,63



● ELEMENTOS DE LA CARTERA DE TÍTULOS

Elementos de la cartera de títulos	Porcentaje de patrimonio neto*	Porcentaje total de activos**
A) Los títulos financieros elegibles y los instrumentos del mercado monetario que se pueden negociar en un mercado regulado con arreglo a lo dispuesto en el artículo L. 422-1 del código monetario y financiero francés.	74,48	74,41
B) Los títulos financieros elegibles y los instrumentos del mercado monetario que se pueden negociar en otro mercado regulado de funcionamiento regular, reconocido, abierto al público y cuyo domicilio se encuentre en un Estado miembro de la Unión Europea o en otro Estado parte del Acuerdo sobre el Espacio Económico Europeo.		
C) Los títulos financieros elegibles y los instrumentos del mercado monetario que cotizan de forma oficial en bolsas de valores de terceros países o que se pueden negociar en otros mercados de terceros países, siempre y cuando sean entidades reguladas, de funcionamiento regular, reconocidas y abiertas al público. Además, dichas entidades deberán figurar en una lista de la Autorité des marchés financiers o estar previstas en la legislación, el reglamento o los estatutos del organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios.	6,75	6,75
D) Los títulos financieros elegibles emitidos recientemente mencionados en el apartado I.4º del artículo R. 214-11 del código monetario y financiero francés.	0,00	0,00
E) Otros activos.	9,60	9,59

* Véase el apartado f) del estado del patrimonio

** Véase el apartado d) del estado del patrimonio

**• ASIGNACIÓN DE LOS ACTIVOS DE LOS ELEMENTOS A), B), C), D) DE LA CARTERA DE TÍTULOS, POR DIVISA**

Títulos	Divisa	Importe (EUR)	Porcentaje de patrimonio neto*	Porcentaje total de activos**
Euro	EUR	8 560 839 268,53	81,23	81,16
TOTAL		8 560 839 268,53	81,23	81,16

* Véase el apartado f) del estado del patrimonio

** Véase el apartado d) del estado del patrimonio



• **DISTRIBUCIÓN DE LOS ACTIVOS DE LOS ELEMENTOS A), B), C), D) DE LA CARTERA DE TÍTULOS, POR PAÍS DE RESIDENCIA DEL EMISOR**

País	Porcentaje de patrimonio neto*	Porcentaje total de activos**
FRANCIA	43,60	43,56
LUXEMBURGO	8,88	8,87
PAÍSES BAJOS	6,18	6,17
ESPAÑA	5,51	5,50
REINO UNIDO	4,29	4,28
SUECIA	2,92	2,92
ITALIA	2,51	2,51
ALEMANIA	2,14	2,14
CANADÁ	2,13	2,13
IRLANDA	1,71	1,70
BÉLGICA	0,52	0,52
FINLANDIA	0,47	0,47
ESTADOS UNIDOS	0,33	0,33
AUSTRIA	0,05	0,05
TOTAL	81,23	81,16

* Véase el apartado f) del estado del patrimonio

** Véase el apartado d) del estado del patrimonio

**• DISTRIBUCIÓN DE LOS OTROS ACTIVOS DEL ELEMENTO E) DE LA CARTERA DE TÍTULOS, POR NATURALEZA**

Naturaleza de los activos	Porcentaje de patrimonio neto*	Porcentaje total de activos**
Organismos de inversión colectiva		
OICVM y FIA de carácter general para inversores no profesionales y equivalentes de otros países	9,60	9,59
Otros fondos para inversores no profesionales y equivalentes de otros Estados miembros de la UE	0,00	0,00
Fondos profesionales de carácter general y equivalentes de otros Estados miembros de la UE y vehículos cotizados especializados en titulizaciones	0,00	0,00
Otros fondos de inversión profesionales y equivalentes de otros Estados miembros de la UE y vehículos no cotizados especializados en titulizaciones	0,00	0,00
Otros organismos no europeos	0,00	0,00
Otros activos		
Otros	0,00	0,00
TOTAL	9,60	9,59

* Véase el apartado f) del estado del patrimonio

** Véase el apartado d) del estado del patrimonio



• MOVIMIENTOS EN LA CARTERA DE TÍTULOS DURANTE EL PERIODO EN EUR

Elementos de la cartera de títulos	Movimientos (importes)	
	Adquisiciones	Cesiones
A) Los títulos financieros elegibles y los instrumentos del mercado monetario que se pueden negociar en un mercado regulado con arreglo a lo dispuesto en el artículo L. 422-1 del código monetario y financiero francés.	26 764 421 063,69	25 387 930 547,67
B) Los títulos financieros elegibles y los instrumentos del mercado monetario que se pueden negociar en otro mercado regulado de funcionamiento regular, reconocido, abierto al público y cuyo domicilio se encuentre en un Estado miembro de la Unión Europea o en otro Estado parte del Acuerdo sobre el Espacio Económico Europeo.		
C) Los títulos financieros elegibles y los instrumentos del mercado monetario que cotizan de forma oficial en bolsas de valores de terceros países o que se pueden negociar en otros mercados de terceros países, siempre y cuando sean entidades reguladas, de funcionamiento regular, reconocidas y abiertas al público. Además, dichas entidades deberán figurar en una lista de la Autorité des marchés financiers o estar previstas en la legislación, el reglamento o los estatutos del organismo de inversión colectiva en valores mobiliarios.	625 221 118,93	855 666 800,00
D) Los títulos financieros elegibles emitidos recientemente mencionados en el apartado I.4º del artículo R. 214-11 del código monetario y financiero francés.	0,00	0,00
E) Otros activos.	517 588 243,34	359 006 484,46

• DISTRIBUCIÓN DURANTE EL PERIODO

	Participación	Importe neto unitario EUR	Crédito fiscal (1) EUR	Importe bruto unitario (2) EUR
Dividendos abonados				
Dividendos por abonar				
	OSTRUM SRI MONEY I-D			
	OSTRUM SRI MONEY Participación I 1			
	OSTRUM SRI MONEY Participación R 1			

(1) El crédito fiscal unitario se determinará únicamente en la fecha de distribución, de conformidad con las disposiciones fiscales en vigor.

(2) El importe bruto unitario se determinará únicamente en la fecha de distribución, de conformidad con las disposiciones fiscales en vigor.

• INFORMACIÓN ADICIONAL

Entidad depositaria: CACEIS Bank - 12 place des États-Unis - CS 40083 - 92549 Montrouge Cedex

El estado detallado de periodicidad semestral del activo estará disponible en un plazo de ocho semanas a partir del final del periodo. Podrá recibirlo previa solicitud a la Sociedad Gestora:

Natixis Investment Managers International - 43 avenue Pierre Mendès France - 75013 - Paris



• INFORMACIÓN SOBRE GASTOS DE GESTIÓN VARIABLES

	29/12/2022
Participaciones OSTRUM SRI MONEY I C	
Gastos de gestión variables provisionados	960 943,19
Porcentaje de gastos de gestión variables provisionados	0,02
Gastos de gestión variables adquiridos	0,00
Porcentaje de gastos de gestión variable adquiridos	0,00
Participaciones OSTRUM SRI MONEY I-D	
Gastos de gestión variables provisionados	5628,44
Porcentaje de gastos de gestión variables provisionados	0,02
Gastos de gestión variables adquiridos	0,00
Porcentaje de gastos de gestión variable adquiridos	0,00
Participaciones OSTRUM SRI MONEY Participación I 1	
Gastos de gestión variables provisionados	1800,40
Porcentaje de gastos de gestión variables provisionados	0,02
Gastos de gestión variables adquiridos	0,00
Porcentaje de gastos de gestión variable adquiridos	0,00
Participaciones OSTRUM SRI MONEY Participación R 1	
Gastos de gestión variables provisionados	1042,14
Porcentaje de gastos de gestión variables provisionados	0,01
Gastos de gestión variables adquiridos	0,00
Porcentaje de gastos de gestión variable adquiridos	0,00
Participaciones OSTRUM SRI MONEY R	
Gastos de gestión variables provisionados	20 607,90
Porcentaje de gastos de gestión variables provisionados	0,02
Gastos de gestión variables adquiridos	0,00
Porcentaje de gastos de gestión variable adquiridos	0,00
Participaciones OSTRUM SRI MONEY RE C	
Gastos de gestión variables provisionados	34 621,88
Porcentaje de gastos de gestión variables provisionados	0,01
Gastos de gestión variables adquiridos	0,00
Porcentaje de gastos de gestión variable adquiridos	0,00
Participaciones OSTRUM SRI MONEY T C	
Gastos de gestión variables provisionados	651,75
Porcentaje de gastos de gestión variables provisionados	0,01
Gastos de gestión variables adquiridos	0,00
Porcentaje de gastos de gestión variable adquiridos	0,00

«El importe de los gastos de gestión variables indicado anteriormente es la suma de las provisiones y las recuperaciones de las provisiones que afectaron al patrimonio neto durante el periodo examinado».



- **TRANSPARENCIA DE LAS OPERACIONES DE FINANCIACIÓN DE VALORES Y DE REUTILIZACIÓN DE INSTRUMENTOS FINANCIEROS – REGLAMENTO (UE) 2015/2365 – EN LA DIVISA BASE DEL OIC (EUR)**

Durante el ejercicio fiscal, el OIC no ha llevado a cabo ninguna de las operaciones recogidas en el Reglamento (UE) 2015/2365.



• CARTERA DE TÍTULOS DETALLADA A 29/12/2022 EN EUR

Denominación de los valores	Divisa	Cantidad n.º o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
Obligaciones y valores equivalentes				
Obligaciones y valores equivalentes negociados en un mercado regulado o equivalente				
ALEMANIA				
VONOVIA SE 0,0 % 01/09/2023 EMTN	EUR	15 800 000	15 452 874,00	0,15
TOTAL ALEMANIA			15 452 874,00	0,15
CANADÁ				
Bank of Nova Scotia OISEST+1,0 % 20/12/2023	EUR	16 700 000	16 804 441,26	0,16
BANK OF NOVA SCOTIA TORONTO E3R+0,75 % 01/02/2024	EUR	15 000 000	15 143 582,50	0,14
BANK OF NOVA SCOTIA TORONTO E3R+0,75 % 06/09/2023	EUR	25 000 000	25 138 574,31	0,24
CAN IMP BK E3R+0,75 % 26/01/2024	EUR	25 000 000	25 249 577,78	0,24
NATL BANK OF CANADA E3R+0,75 % 01/02/2024	EUR	23 200 000	23 417 666,27	0,22
ROYAL BANK OF CANADA TORONTO E3R+0,75 % 31/01/2024	EUR	20 000 000	20 197 391,67	0,19
TOTAL CANADÁ			125 951 233,79	1,19
ESPAÑA				
BANCO SANTANDER E3R+0,75 % 28/03/2023	EUR	17 200 000	17 223 053,26	0,17
BANCO SANTANDER E3R+1,0 % 05/05/2024	EUR	46 100 000	46 685 295,84	0,44
BBVA E3R+0,6 % 09/03/2023 EMTN	EUR	55 300 000	55 410 692,17	0,52
BBVA E3R+0,7 % 11/07/2024 EMTN	EUR	40 000 000	40 243 702,22	0,38
BBVA E3R+1,0 % 09/09/2023 EMTN	EUR	74 700 000	75 222 443,50	0,71
IBERDROLA FINANZAS SAU E3R+0,65 % 04/12/2023	EUR	25 000 000	25 110 225,00	0,24
IBERDROLA FINANZAS SAU E3R+0,65 % 28/04/2023	EUR	30 000 000	30 134 313,33	0,29
TOTAL ESPAÑA			290 029 725,32	2,75
ESTADOS UNIDOS				
BK AME 0,75 % 26/07/2023 EMTN	EUR	18 000 000	17 875 178,63	0,16
GOLD SACH GR E3R+1,0 % 30/04/2024	EUR	10 000 000	10 044 893,06	0,10
TOTAL ESTADOS UNIDOS			27 920 071,69	0,26
FRANCIA				
BFCM 2,625 % 03/2024	EUR	27 100 000	27 490 741,16	0,26
BFCM BANQUE FEDERATIVE CREDIT MUTUEL 0,75 % 15/06/2023	EUR	10 500 000	10 465 223,42	0,10
BN 1,125 % 15/01/2023 EMTN	EUR	40 000 000	40 420 641,10	0,38
BNP PAR E3R+0,62 % 22/05/2023	EUR	12 618 000	12 670 980,53	0,12
BPCE 1,125 % 18/01/2023 EMTN	EUR	14 800 000	14 954 268,71	0,14
BPCE E3R+0,5 % 23/03/2023 EMTN	EUR	15 500 000	15 515 866,83	0,15
ENGIE 3 % 02/2023	EUR	5 399 000	5 550 255,57	0,05
HSBC CONTINENTAL EUROPE E3R+1,0 % 26/11/2023	EUR	25 000 000	25 206 352,78	0,24
SG E3R+0,45 % 06/03/2023 EMTN	EUR	11 600 000	11 622 379,94	0,11
VILOGIA STE ANONYME D HLM E3R+0,75 % 27/07/2023	EUR	20 600 000	20 730 238,35	0,20
TOTAL FRANCIA			184 626 948,39	1,75
IRLANDA				
INTESA BANK IRELAND E3R+0,7 % 20/01/2023	EUR	30 000 000	30 131 256,67	0,29
TOTAL IRLANDA			30 131 256,67	0,29
ITALIA				
INTESA SANPAOLO E3R+0,6 % 17/03/2023	EUR	2 900 000	2 886 417,27	0,04
UNICR 2,0 % 04/03/2023 EMTN	EUR	16 000 000	16 257 413,70	0,15
TOTAL ITALIA			19 143 830,97	0,19
LUXEMBURGO				
CODEIS SECURITIES OISEST+0,075 % 21/02/2023	EUR	250 000 000	250 321 841,81	2,38



• **CARTERA DE TÍTULOS DETALLADA A 29/12/2022 EN EUR (continuación)**

Denominación de los valores	Divisa	Cantidad n.º o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0,0 % 15/03/2023	EUR	10 000 000	9 957 700,00	0,09
PURPLE PROTECTED ASSET OIEST+0,02 % 17/11/2023	EUR	275 000 000	275 490 355,25	2,61
PURPLE PROTECTED ASSET OIEST+0,02 % 18/10/2023	EUR	100 000 000	100 266 454,00	0,95
SG ISSUER OIEST+0,07 % 16/06/2023	EUR	100 000 000	100 287 232,56	0,95
SG ISSUER OIEST+0,075 % 03/02/2023	EUR	50 000 000	50 051 863,19	0,48
TOTAL LUXEMBURGO			786 375 446,81	7,46
PAÍSES BAJOS				
BMW FIN 0,0 % 24/03/2023 EMTN	EUR	18 600 000	18 530 808,00	0,18
DAIMLER INTL FINANCE BV 0,625 % 27/02/2023	EUR	28 185 000	28 256 381,41	0,26
DAIMLER INTL FINANCE BV E3R+0,25 % 11/01/2023	EUR	9 700 000	9 731 574,04	0,09
DE VOLKSBANK NV E3R+0,55 % 12/09/2024	EUR	25 000 000	25 153 736,11	0,24
HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV E3R+0,55 % 19/01/2024	EUR	25 000 000	23 983 680,56	0,23
THERMO FISHER SCIENTIFIC FINANCE I BV E3R+0,2 % 18/11/2023	EUR	55 000 000	55 045 165,69	0,52
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0,75 % 19/01/2023	EUR	15 000 000	15 066 670,00	0,15
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0,75 % 24/05/2023	EUR	30 000 000	30 149 112,50	0,29
TOYOTA MOTOR FINANCE NETHERLANDS BV E3R+0,75 % 28/04/2023	EUR	15 000 000	15 070 700,00	0,14
TOTAL PAÍSES BAJOS			220 987 828,31	2,10
REINO UNIDO				
BARCLAYS BK E3R+0,18 % 20/01/2023	EUR	20 000 000	20 006 515,56	0,19
BARCLAYS BK ZCP 26/01/2023	EUR	50 000 000	49 923 700,00	0,47
CASA LONDON E3R+0,6 % 06/03/2023	EUR	19 600 000	19 644 984,72	0,19
HSBC BK E3R+1,0 % 08/03/2023 EMTN	EUR	103 300 000	103 634 270,19	0,98
UBS AG LONDON 0,75 % 21/04/2023	EUR	24 448 000	24 466 778,07	0,23
TOTAL REINO UNIDO			217 676 248,54	2,06
SUECIA				
VATTENFALL AB E3R+0,5 % 18/04/2024	EUR	13 700 000	13 784 337,20	0,13
VOLVO TREASURY AB AUTRE V 27/09/2023	EUR	15 000 000	15 047 620,83	0,14
VOLVO TREASURY AB E3R+0,75 % 13/09/2023	EUR	50 000 000	50 180 722,22	0,48
TOTAL SUECIA			79 012 680,25	0,75
TOTAL Obligaciones y valores equivalentes negociados en un mercado regulado o equivalente			1 997 308 144,74	18,95
TOTAL Obligaciones y valores equivalentes			1 997 308 144,74	18,95
Títulos de deuda				
Títulos de deuda negociados en un mercado regulado o equivalente				
ALEMANIA				
DEUTSCHE TELEKOM AG 010223 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 908 446,28	0,48
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 130123 FIX 0,0	EUR	10 000 000	9 992 263,99	0,09
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 240123 FIX 0,0	EUR	9 000 000	8 987 574,68	0,09
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA 280323 FIX 0,0	EUR	4 000 000	3 977 076,13	0,04
FRES MEDI CARE AG ZCP 08/03/2023	EUR	20 000 000	19 914 692,98	0,19
SANTANDER CONSUMER BANK AG 011223 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 252 041,18	0,23
SANTANDER CONSUMER BANK AG 021123 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 334 122,69	0,23
SANTANDER CONSUMER BANK AG 150323 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 771 868,57	0,48
SAP SE 020323 FIX 0,0	EUR	14 000 000	13 947 744,47	0,13
SCHAEFFLER AG 020223 FIX 0,0	EUR	2 000 000	1 995 186,07	0,01



• **CARTERA DE TÍTULOS DETALLADA A 29/12/2022 EN EUR (continuación)**

Denominación de los valores	Divisa	Cantidad n.º o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
SCHAEFFLER AG 090123 FIX 0,0	EUR	3 000 000	2 997 900,47	0,03
TOTAL ALEMANIA			210 078 917,51	2,00
AUSTRIA				
BÉLGICA				
COFINIMMO SA 240123 FIX 0,0	EUR	5 000 000	4 993 271,91	0,05
SUMITOMO MITSU 010223 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 907 587,78	0,47
TOTAL BÉLGICA			54 900 859,69	0,52
CANADÁ				
Bank of Montreal 071123 OISEST 0,4	EUR	25 000 000	25 088 564,81	0,24
ROYAL BANK OF CANADA 100823 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 571 223,08	0,23
TORONTO DOMINION BANK, THE 080523 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 807 950,90	0,24
TORONTO DOMINION BANK, THE 140823 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 571 430,10	0,23
TOTAL CANADÁ			99 039 168,89	0,94
ESPAÑA				
BANCO SANTANDER SA 060223 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 895 612,83	0,47
BANCO SANTANDER SA 270323 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 734 006,37	0,47
ENDESA SA 250123 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 961 330,74	0,24
ENDESA SA 260123 FIX 0,0	EUR	99 000 000	98 840 989,56	0,93
FERROVIAL SA 020223 FIX 0,0	EUR	9 000 000	8 983 307,27	0,09
FERROVIAL SA 090123 FIX 0,0	EUR	2 000 000	1 998 928,35	0,02
TOTAL ESPAÑA			234 414 175,12	2,22
FRANCIA				
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 060323 FIX 0,0	EUR	16 000 000	15 934 725,00	0,15
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 160123 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 976 705,75	0,24
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 270323 FIX 0,0	EUR	8 500 000	8 451 370,11	0,08
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 310123 FIX 0,0	EUR	13 500 000	13 476 016,28	0,13
ALSTOM SA 130323 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 882 839,15	0,24
ALSTOM SA 160123 FIX 0,0	EUR	4 000 000	3 996 329,48	0,04
ALSTOM SA 160223 FIX 0,0	EUR	11 000 000	10 968 863,05	0,11
ALSTOM SA 200223 FIX 0,0	EUR	5 000 000	4 984 406,89	0,04
ARKEA - COMPAGNIE FINANCI 210323 OISEST 0,14	EUR	50 000 000	50 152 819,03	0,47
ARKEMA 120923 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 472 439,46	0,23
AXA SA 130423 FIX 0,0	EUR	8 000 000	7 944 995,03	0,08
AXA SA 200323 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 874 406,36	0,23
BEL SA 050123 FIX 0,0	EUR	7 000 000	6 997 187,36	0,07
BFCM (BANQUE FEDER) 100723 OISEST 0,28	EUR	50 000 000	50 087 750,81	0,47
BFCM (BANQUE FEDER) 200723 OISEST 0,19	EUR	50 000 000	50 032 964,86	0,48
BFCM (BANQUE FEDER) 220523 OISEST 0,18	EUR	50 000 000	50 098 126,19	0,47
BFCM (BANQUE FEDER) 230523 OISEST 0,21	EUR	50 000 000	50 103 214,86	0,48
BFCM (BANQUE FEDER) 290523 OISEST 0,21	EUR	50 000 000	50 090 494,00	0,48
BFCM (BANQUE FEDERATIVE) 110423 OISEST 0,18	EUR	50 000 000	50 113 131,08	0,48
BNP PARIBAS 010223 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 909 761,49	0,47
BNP PARIBAS 100223 OISEST 0,14	EUR	100 000 000	100 369 607,44	0,95
BNP PARIBAS 200323 OISEST 0,11	EUR	30 000 000	30 109 804,85	0,28
BNP PARIBAS 210323 OISEST 0,1	EUR	20 000 000	20 071 372,22	0,19
BNP PARIBAS 210423 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 628 605,98	0,47
BNP PARIBAS 220923 FIX 0,0	EUR	50 000 000	48 908 030,14	0,46



• CARTERA DE TÍTULOS DETALLADA A 29/12/2022 EN EUR (continuación)

Denominación de los valores	Divisa	Cantidad n.º o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
BONDUELLE 301222 FIX 0,0	EUR	6 000 000	6 000 000,00	0,06
BPCE OIEST+0,17 % 04/05/2023	EUR	50 000 000	50 140 011,56	0,48
BPCE OIEST+0,19 % 09/06/2023	EUR	50 000 000	50 129 400,17	0,47
BPCE SA 190623 OIEST 0,19	EUR	75 000 000	75 163 846,54	0,72
BPCE SA 310123 OIEST 0,1	EUR	50 000 000	50 131 798,33	0,47
BPCE SA 310323 OIEST 0,13	EUR	100 000 000	100 208 095,39	0,95
BPIFRANCE SA 300323 FIX 0,0	EUR	10 000 000	9 945 258,81	0,10
BRED BANQUE POPULAIRE 080323 OIEST 0,12	EUR	50 000 000	50 059 411,92	0,48
BRED BANQUE POPULAIRE 100123 OIEST 0,08	EUR	50 000 000	50 149 520,75	0,47
BRED BANQUE POPULAIRE 120423 OIEST 0,12	EUR	50 000 000	50 048 811,00	0,47
CA CON OIEST+0,25 % 05/01/2024	EUR	25 000 000	25 096 189,22	0,24
CA OIEST+0,16 % 18/01/2023	EUR	50 000 000	50 191 844,79	0,47
CA OIEST+0,17 % 12/06/2023	EUR	50 000 000	50 127 398,61	0,48
CARREFOUR SA 270123 FIX 0,0	EUR	15 000 000	14 976 823,86	0,15
CDC HABITAT 200123 FIX 0,0	EUR	35 000 000	34 959 163,33	0,33
CDC HABITAT 250423 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 794 014,91	0,24
CICOBAIL 110823 FIX 0,0	EUR	3 000 000	2 944 202,52	0,03
COFACE 230123 FIX 0,0	EUR	9 000 000	8 988 096,76	0,08
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 020323 FIX 0	EUR	8 000 000	7 967 970,04	0,08
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 190123 FIX 0,0	EUR	11 000 000	10 987 567,57	0,10
COMPAGNIE PLASTIC OMNIUM SE 280223 FIX 0,0	EUR	2 000 000	1 992 310,35	0,02
CREDIT AGRICOLE CORP IB 010223 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 910 971,72	0,47
CREDIT AGRICOLE SA 020823 OIEST 0,2	EUR	50 000 000	50 075 456,22	0,48
CREDIT AGRICOLE SA 030723 OIEST 0,18	EUR	50 000 000	50 076 978,44	0,48
CREDIT AGRICOLE SA 090323 OIEST 0,09	EUR	50 000 000	50 052 423,96	0,48
CREDIT AGRICOLE SA 130223 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 873 309,33	0,47
CREDIT AGRICOLE SA 210923 OIEST 0,28	EUR	50 000 000	50 214 480,56	0,48
CREDIT AGRICOLE SA 220523 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 487 780,71	0,47
CREDIT LYONNAIS 080223 OIEST 0,08	EUR	50 000 000	50 053 039,69	0,48
CREDIT LYONNAIS 100723 OIEST 0,2	EUR	50 000 000	50 065 206,36	0,48
CREDIT LYONNAIS 160123 OIEST 0,06	EUR	50 000 000	50 063 461,78	0,47
CREDIT LYONNAIS 230523 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 480 866,54	0,47
CRED L OIEST+0,09 % 28/02/2023	EUR	50 000 000	50 112 916,83	0,48
CRED L OIEST+0,09 % 31/01/2023	EUR	50 000 000	50 138 884,00	0,47
CRED LYONNAIS OIEST+0,29 % 22/09/2023	EUR	50 000 000	50 189 721,17	0,47
CRED M OIEST+0,07 % 20/03/2023	EUR	50 000 000	50 029 845,10	0,47
CRED M OIEST+0,14 % 27/03/2023	EUR	50 000 000	50 147 172,36	0,48
CRED M OIEST+0,15 % 08/06/2023	EUR	50 000 000	50 056 728,58	0,48
CRED M OIEST+0,15 % 30/05/2023	EUR	25 000 000	25 037 504,79	0,24
CRED M OIEST+0,17 % 13/07/2023	EUR	50 000 000	50 041 612,08	0,47
CRED MUTU ARKE ZCP 03/05/2023	EUR	50 000 000	49 575 422,86	0,47
CRED MUTU ARKE ZCP 26/06/2023	EUR	50 000 000	49 323 869,49	0,47
DANONE SA 210323 FIX 0,0	EUR	10 000 000	9 950 122,28	0,09
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 050623 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 707 315,02	0,24
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 060223 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 889 338,24	0,47
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 060323 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 896 430,43	0,24
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 120623 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 689 847,51	0,23



• CARTERA DE TÍTULOS DETALLADA A 29/12/2022 EN EUR (continuación)

Denominación de los valores	Divisa	Cantidad n.º o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 130223 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 865 773,80	0,47
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 170123 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 949 376,31	0,47
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 180123 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 973 283,44	0,24
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 230123 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 932 524,52	0,47
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 230223 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 915 199,04	0,24
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 260123 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 924 102,88	0,48
ELECTRICITE DE FRANCE EDF 280223 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 811 959,85	0,47
ENGIE SA 030123 OIEST 0,08	EUR	25 000 000	25 033 023,78	0,24
ENGIE SA 060323 OIEST 0,1	EUR	50 000 000	50 060 061,11	0,47
ENGIE SA 070323 OIEST 0,1	EUR	25 000 000	25 027 567,40	0,23
ENGIE SA 130323 OIEST 0,1	EUR	25 000 000	25 025 980,50	0,24
ENGIE SA 140223 OIEST 0,11	EUR	50 000 000	50 104 158,86	0,48
ENGIE SA 210223 OIEST 0,1	EUR	25 000 000	25 044 297,38	0,24
ENGIE SA 210323 OIEST 0,08	EUR	25 000 000	25 005 713,19	0,24
ENGIE SA 240123 OIEST 0,13	EUR	40 000 000	40 116 077,44	0,38
ENGIE SA 280223 OIEST 0,1	EUR	100 000 000	100 141 052,50	0,95
ENGIE SA 280223 OIEST 0,1	EUR	50 000 000	50 074 705,11	0,48
GECINA 020223 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 953 718,34	0,23
GECINA 250123 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 965 201,28	0,24
GECINA 300123 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 958 157,72	0,24
HSBC C OIEST+0,3 % 29/09/2023	EUR	25 000 000	25 111 555,08	0,23
IMERYS 250123 FIX 0,0	EUR	14 500 000	14 476 116,66	0,14
KLEPIERRE 030423 FIX 0,0	EUR	20 000 000	19 882 768,22	0,19
KLEPIERRE 070623 FIX 0,0	EUR	10 000 000	9 886 699,17	0,10
KLEPIERRE 080623 FIX 0,0	EUR	22 000 000	21 748 796,57	0,21
KLEPIERRE 090623 FIX 0,0	EUR	15 000 000	14 827 398,01	0,14
KLEPIERRE 260123 FIX 0,0	EUR	15 000 000	14 978 122,58	0,15
LEGRAND 0,0 % 27/04/2023	EUR	38 000 000	37 682 814,00	0,36
NATIXIS BAIL 110823 FIX 0,0	EUR	3 000 000	2 944 188,14	0,02
NATIXIS ZCP 20/02/2023	EUR	50 000 000	49 845 741,28	0,47
ORAN OIEST+0,08 % 16/01/2023	EUR	10 000 000	10 029 143,17	0,09
SCHNEIDER ELECTRIC SE 020323 FIX 0,0	EUR	20 000 000	19 921 671,31	0,19
SCHNEIDER ELECTRIC SE 060323 FIX 0,0	EUR	15 000 000	14 937 056,49	0,14
SCHNEIDER ELECTRIC SE 230223 FIX 0,0	EUR	13 000 000	12 955 652,98	0,13
SCHNEIDER ELECTRIC SE 250123 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 962 986,82	0,23
SEB SA 040123 FIX 0,0	EUR	13 000 000	12 996 317,71	0,12
SEB SA 190123 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 971 698,74	0,24
SEB SA 220323 FIX 0,0	EUR	20 000 000	19 895 394,11	0,19
SG OIEST+0,14 % 31/03/2023	EUR	50 000 000	50 180 887,93	0,48
SG OIEST+0,15 % 31/05/2023	EUR	50 000 000	50 080 609,58	0,48
SG OIEST+0,22 % 15/05/2023	EUR	25 000 000	25 096 855,13	0,24
SG OIEST+0,26 % 31/05/2023	EUR	25 000 000	25 110 908,69	0,23
SG OIEST+0,26 % 31/07/2023	EUR	50 000 000	50 238 013,79	0,48
SG OIEST+0,31 % 26/10/2023	EUR	50 000 000	50 194 769,58	0,47
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 170123 FIX 0,0	EUR	10 000 000	9 990 311,90	0,09
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 180123 FIX 0,0	EUR	10 000 000	9 989 774,22	0,09
SOCIETE FONCIERE LYONNAISE 190123 FIX 0,0	EUR	11 000 000	10 988 160,26	0,10



• CARTERA DE TÍTULOS DETALLADA A 29/12/2022 EN EUR (continuación)

Denominación de los valores	Divisa	Cantidad n.º o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
SOCIETE GENERALE SA 310323 OISEST 0,11	EUR	50 000 000	50 147 699,46	0,47
SODEXO 160123 FIX 0,0	EUR	12 500 000	12 483 300,36	0,12
SODEXO 190123 FIX 0,0	EUR	16 500 000	16 474 072,56	0,16
TECHNIP EURO CASH SNC 210223 FIX 0,0	EUR	15 000 000	14 950 373,44	0,14
TELEPERFORMANCE SE 070323 FIX 0,0	EUR	12 000 000	11 939 802,50	0,11
TELEPERFORMANCE SE 080223 FIX 0,0	EUR	5 000 000	4 985 873,91	0,05
TELEPERFORMANCE SE 100123 FIX 0,0	EUR	10 000 000	9 992 431,01	0,09
TELEPERFORMANCE SE 140223 FIX 0,0	EUR	10 000 000	9 967 074,38	0,10
TELEPERFORMANCE SE 270223 FIX 0,0	EUR	5 000 000	4 978 280,33	0,05
VALEO SA 060123 FIX 0,0	EUR	10 000 000	9 994 923,88	0,09
VALEO SA 190123 FIX 0,0	EUR	9 500 000	9 486 234,95	0,09
VEOLIA ENVIRONNEMENT 060223 FIX 0,0	EUR	42 000 000	41 908 867,07	0,40
VEOLIA ENVIRONNEMENT 230123 FIX 0,0	EUR	39 000 000	38 948 147,03	0,36
VINCI S. A. 270123 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 961 219,97	0,24
VINCI S. A. 270323 FIX 0,0	EUR	20 000 000	19 885 959,00	0,19
TOTAL FRANCIA			4 409 689 015,77	41,84
IRLANDA				
DXC CAPITAL FUNDING DAC 060123 FIX 0,0	EUR	4 000 000	3 998 344,02	0,04
DXC CAPITAL FUNDING DAC 090123 FIX 0,0	EUR	5 000 000	4 997 043,42	0,05
DXC CAPITAL FUNDING DAC 130223 FIX 0,0	EUR	4 000 000	3 988 374,39	0,04
DXC CAPITAL FUNDING DAC 160223 FIX 0,0	EUR	10 000 000	9 968 532,67	0,10
DXC CAPITAL FUNDING DAC 200223 FIX 0,0	EUR	10 000 000	9 965 237,93	0,09
DXC CAPITAL FUNDING DAC 270223 FIX 0,0	EUR	5 000 000	4 979 612,93	0,04
DXC CAPITAL FUNDING DAC 280223 FIX 0,0	EUR	5 000 000	4 979 170,47	0,04
DXC CAPITAL FUNDING DAC 300123 FIX 0,0	EUR	5 000 000	4 990 693,24	0,05
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 080223 FIX 0,0	EUR	30 000 000	29 932 651,53	0,28
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 300123 FIX 0,0	EUR	30 000 000	29 949 225,41	0,29
TOTAL IRLANDA			107 748 886,01	1,02
ITALIA				
ITAL BUON ORDINI DEL ZCP 28/04/2023	EUR	50 000 000	49 656 401,56	0,47
ITALY BUONI TES BOT ZCP 310323	EUR	50 000 000	49 756 252,41	0,47
SNAM SPA 230123 FIX 0,0	EUR	67 000 000	66 901 485,33	0,64
UNICREDIT SPA 100223 FIX 0,0	EUR	30 000 000	29 928 104,21	0,28
UNICREDIT SPA 140423 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 652 677,45	0,47
TOTAL ITALIA			245 894 920,96	2,33
LUXEMBURGO				
INTE BANK LUXE ZCP 24/02/2023	EUR	50 000 000	49 835 266,76	0,48
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 150223 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 865 317,10	0,47
TOTAL LUXEMBURGO			99 700 583,86	0,95
PAÍSES BAJOS				
AKZO NOBEL NV 120123 FIX 0,0	EUR	39 000 000	38 970 911,46	0,37
AKZO NOBEL NV 140223 FIX 0,0	EUR	14 500 000	14 458 105,95	0,14
AKZO NOBEL NV 310123 FIX 0,0	EUR	14 000 000	13 973 771,54	0,13
AKZO NOBEL NV 310123 FIX 0,0	EUR	15 000 000	14 971 898,08	0,14
EDP FINANCE BV 030223 FIX 0,0	EUR	20 000 000	19 960 069,05	0,19
EDP FINANCE BV 090123 FIX 0,0	EUR	20 000 000	19 988 881,18	0,19
EDP FINANCE BV 100123 FIX 0,0	EUR	15 000 000	14 990 827,49	0,15



• **CARTERA DE TÍTULOS DETALLADA A 29/12/2022 EN EUR (continuación)**

Denominación de los valores	Divisa	Cantidad n.º o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
EDP FINANCE BV 270123 FIX 0,0	EUR	21 000 000	20 967 343,36	0,19
EDP FINANCE BV 310123 FIX 0,0	EUR	4 000 000	3 992 780,70	0,04
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 020323 FIX 0,0	EUR	21 000 000	20 911 039,56	0,20
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 280223 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 897 670,57	0,24
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 010223 FIX 0.	EUR	50 000 000	49 911 031,09	0,48
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 160523 FIX 0.	EUR	30 000 000	29 720 051,64	0,28
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 220323 FIX 0.	EUR	27 000 000	26 869 582,66	0,25
ING BANK N.V. 171023 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 391 394,86	0,23
STEDIN HOLDING NV 160123 FIX 0,0	EUR	7 000 000	6 993 128,88	0,07
TELEFONICA EUROPE BV 030223 FIX 0,0	EUR	30 000 000	29 934 129,12	0,28
TOTAL PAÍSES BAJOS			375 902 617,19	3,57
REINO UNIDO				
DNB BANK ASA 040823 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 589 621,15	0,24
MUFG BANK LTD 230123 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 935 859,05	0,47
RECKITT BENCKI 300523 FIX 0,0	EUR	7 000 000	6 918 783,36	0,06
RECKITT BENCKI 310523 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 707 485,34	0,23
ROYA BANK OF CANA ZCP 15/05/2023	EUR	25 000 000	24 784 045,60	0,24
ROYAL BANK OF CANADA 260423 FIX 0,0	EUR	30 000 000	29 786 907,44	0,28
THE TORO BANK LOND ZCP 01/08/2023	EUR	25 000 000	24 606 715,11	0,24
THE TORO BANK LOND ZCP 05/12/2023	EUR	25 000 000	24 262 494,31	0,23
TOTAL REINO UNIDO			209 591 911,36	1,99
SUECIA				
ESSITY AB 200223 FIX 0,0	EUR	15 000 000	14 954 396,40	0,14
ESSITY AB 240223 FIX 0,0	EUR	22 000 000	21 927 109,42	0,21
SKANDINAVISKA ENSKI 280423 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 617 520,59	0,47
SVENSKA HANDELSBANKEN AB 060223 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 903 287,43	0,47
VATTENFALL AB 110423 FIX 0,0	EUR	9 000 000	8 935 172,49	0,09
VATTENFALL AB 130123 FIX 0,0	EUR	14 000 000	13 989 065,21	0,13
VATTENFALL AB 140323 FIX 0,0	EUR	21 000 000	20 897 883,19	0,20
VATTENFALL AB 160123 FIX 0,0	EUR	14 000 000	13 986 724,27	0,13
VATTENFALL AB 250423 FIX 0,0	EUR	35 000 000	34 706 330,46	0,33
TOTAL SUECIA			228 917 489,46	2,17
TOTAL Títulos de deuda negociados en un mercado regulado o equivalente			6 280 871 408,92	59,60
Títulos de deuda no negociados en un mercado regulado o equivalente				
ESPAÑA				
CAIXABANK SA 060223 FIX 0,0	EUR	6 000 000	5 987 391,55	0,06
SANTANDER CONSUMER FINANCE, S.A. 300123	EUR	50 000 000	49 912 273,49	0,47
TOTAL ESPAÑA			55 899 665,04	0,53
ESTADOS UNIDOS				
DANAHER CORP 120123 FIX 0,0	EUR	7 000 000	6 994 502,61	0,06
TOTAL ESTADOS UNIDOS			6 994 502,61	0,06
FINLANDIA				
NORDEA BANK ABP. 020223 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 914 701,88	0,48
TOTAL FINLANDIA			49 914 701,88	0,48
IRLANDA				
DXC CAPI FUND ZCP 07/02/2023	EUR	4 000 000	3 990 228,00	0,03



• **CARTERA DE TÍTULOS DETALLADA A 29/12/2022 EN EUR (continuación)**

Denominación de los valores	Divisa	Cantidad n.º o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
DXC CAPITAL FUNDING DAC 160123	EUR	4 000 000	3 995 980,71	0,04
DXC CAPITAL FUNDING DAC 160123 FIX 0,0	EUR	4 000 000	3 995 980,71	0,04
INTESA SANPAOLO BANK IRELAND PLC 280323	EUR	30 000 000	29 827 048,85	0,28
TOTAL IRLANDA			41 809 238,27	0,39
LUXEMBURGO				
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 160323 FIX 0,0	EUR	50 000 000	49 760 810,29	0,47
TOTAL LUXEMBURGO			49 760 810,29	0,47
PAÍSES BAJOS				
BMW FINANCE NV 170123 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 975 773,50	0,24
ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 300123 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 950 444,61	0,23
STEDIN HOLDING NV 090123 FIX 0,0	EUR	4 000 000	3 997 689,45	0,04
TOTAL PAÍSES BAJOS			53 923 907,56	0,51
REINO UNIDO				
UBS AG 201023 FIX 0,0	EUR	25 000 000	24 356 889,22	0,24
TOTAL REINO UNIDO			24 356 889,22	0,24
TOTAL Títulos de deuda no negociados en un mercado regulado o equivalente			282 659 714,87	2,68
TOTAL Títulos de deuda			6 563 531 123,79	62,28
Organismos de inversión colectiva				
OICVM y FIA de carácter general para inversores no profesionales y equivalentes de otros países				
FRANCIA				
OSTRUM SRI CASH A1P1 Participación IC	EUR	1 824	210 068 718,57	1,99
OSTRUM SRI CASH Participación I	EUR	18 620	200 194 047,20	1,90
OSTRUM SRI CASH PLUS I	EUR	2 973	300 764 199,06	2,86
OSTRUM SRI MONEY PLUS IC	EUR	2 935	300 512 478,10	2,85
TOTAL FRANCIA			1 011 539 442,93	9,60
TOTAL OICVM y FIA de carácter general para inversores no profesionales y equivalentes de otros países			1 011 539 442,93	9,60
TOTAL Organismos de inversión colectiva			1 011 539 442,93	9,60
Instrumento financiero a plazo				
Otros instrumentos financieros a plazo				
Swaps de tipos				
E3R/0,0/FIX/-0,405	EUR	18 000 000	403 678,00	0,00
E3R/0,0/FIX/-0,442	EUR	20 000 000	283 418,89	0,00
E3R/0,0/FIX/-0,46	EUR	4 448 000	63 830,78	0,00
E3R/0,0/FIX/-0,464	EUR	5 399 000	47 920,77	0,00
E3R/0,0/FIX/-0,47	EUR	10 000 000	98 403,33	0,00
E3R/0,0/FIX/-0,495	EUR	10 500 000	183 736,88	0,00
E3R/0,0/FIX/-0,504	EUR	7 800 000	67 617,98	0,01
E3R/0,0/FIX/-0,506	EUR	15 800 000	408 648,57	0,00
E3R/0,0/FIX/-0,511	EUR	18 600 000	192 149,37	0,00
E3R/0,0/FIX/-0,513	EUR	40 000 000	345 922,78	0,00
OISEST/0,0/FIX/0,132	EUR	7 000 000	17 511,86	0,00
OISEST/0,0/FIX/0,447	EUR	50 000 000	147 279,06	0,00
OISEST/0,0/FIX/0,457	EUR	50 000 000	144 673,50	0,00
OISEST/0,0/FIX/0,48	EUR	50 000 000	128 472,92	0,00
OISEST/0,0/FIX/0,48	EUR	15 000 000	33 301,00	0,00
OISEST/0,0/FIX/0,482	EUR	25 000 000	56 184,31	0,00



• CARTERA DE TÍTULOS DETALLADA A 29/12/2022 EN EUR (continuación)

Denominación de los valores	Divisa	Cantidad n.º o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
OISEST/0,0/FIX/0,486	EUR	50 000 000	120 823,26	0,00
OISEST/0,0/FIX/-0,50	EUR	50 000 000	341 972,57	0,00
OISEST/0,0/FIX/0,508	EUR	50 000 000	118 359,92	0,00
OISEST/0,0/FIX/-0,51	EUR	7 000 000	44 350,59	0,00
OISEST/0,0/FIX/-0,51	EUR	25 000 000	160 684,30	0,00
OISEST/0,0/FIX/-0,51	EUR	28 185 000	262 902,36	0,00
OISEST/0,0/FIX/-0,57	EUR	38 000 000	573 881,30	0,01
OISEST/0,0/FIX/0,61	EUR	50 000 000	135 710,63	0,00
OISEST/0,0/FIX/0,611	EUR	50 000 000	127 956,11	0,01
OISEST/0,0/FIX/0,648	EUR	50 000 000	141 662,75	0,00
OISEST/0,0/FIX/0,72	EUR	25 000 000	299 786,46	0,00
OISEST/0,0/FIX/0,802	EUR	25 000 000	286 519,52	0,00
OISEST/0,0/FIX/0,899	EUR	6 000 000	67 020,73	0,00
OISEST/0,0/FIX/0,922	EUR	25 000 000	271 092,64	0,00
OISEST/0,0/FIX/0,932	EUR	25 000 000	278 320,59	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,202	EUR	25 000 000	27 302,39	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,228	EUR	12 000 000	12 378,12	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,237	EUR	13 000 000	275,80	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,292	EUR	35 000 000	-2 101,94	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,302	EUR	25 000 000	-1 145,84	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,304	EUR	10 000 000	243,78	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,318	EUR	50 000 000	-4 154,87	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,32	EUR	10 000 000	324,15	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,355	EUR	30 000 000	371,61	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,357	EUR	7 000 000	48,98	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,367	EUR	9 000 000	6,30	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,375	EUR	10 000 000	-46,34	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,404	EUR	14 000 000	-235,12	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,430	EUR	10 000 000	-91,58	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,453	EUR	10 000 000	-343,69	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,475	EUR	11 000 000	-619,52	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,478	EUR	9 500 000	-611,04	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,48	EUR	11 000 000	-762,52	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,495	EUR	30 000 000	-400,05	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,534	EUR	4 000 000	-110,44	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,552	EUR	9 000 000	-873,98	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,555	EUR	5 000 000	-999,15	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,557	EUR	9 000 000	-895,35	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,559	EUR	2 500 000	-260,51	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,56	EUR	5 000 000	-535,34	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,57	EUR	10 000 000	-948,50	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,574	EUR	50 000 000	-3 763,75	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,577	EUR	25 000 000	-2 930,84	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,579	EUR	25 000 000	-3 047,50	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,58	EUR	14 000 000	-896,28	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,587	EUR	6 000 000	-115,85	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,594	EUR	15 000 000	-1 385,80	0,00



• CARTERA DE TÍTULOS DETALLADA A 29/12/2022 EN EUR (continuación)

Denominación de los valores	Divisa	Cantidad n.º o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
OISEST/0,0/FIX/1,596	EUR	5 000 000	-319,40	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,597	EUR	2 000 000	-132,18	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,598	EUR	20 000 000	-1 356,51	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,605	EUR	30 000 000	-1 999,35	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,605	EUR	15 000 000	-993,61	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,607	EUR	4 000 000	-286,98	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,609	EUR	25 000 000	-1 034,17	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,613	EUR	2 500 000	-219,12	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,613	EUR	21 000 000	-2 407,54	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,616	EUR	25 000 000	-2 397,37	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,635	EUR	13 500 000	-763,20	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,637	EUR	14 000 000	-840,47	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,645	EUR	20 000 000	-3 106,95	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,645	EUR	99 000 000	-6 570,46	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,665	EUR	15 000 000	-2 599,80	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,667	EUR	4 000 000	-555,47	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,675	EUR	4 000 000	-362,22	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,68	EUR	25 000 000	-2 491,66	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,683	EUR	25 000 000	161 151,52	0,01
OISEST/0,0/FIX/1,683	EUR	4 000 000	-479,51	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,684	EUR	50 000 000	-4 638,41	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,684	EUR	4 000 000	-488,62	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,7	EUR	50 000 000	-8 384,94	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,7	EUR	50 000 000	1 032,38	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,704	EUR	20 000 000	-4 320,50	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,71	EUR	20 000 000	-2 964,27	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,71	EUR	30 000 000	-4 446,40	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,720	EUR	6 000 000	-861,28	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,721	EUR	42 000 000	-6 136,29	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,726	EUR	3 000 000	-53,61	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,727	EUR	10 000 000	-1 416,02	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,737	EUR	22 000 000	-4 432,63	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,743	EUR	5 000 000	-722,87	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,747	EUR	30 000 000	-4 608,90	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,749	EUR	16 000 000	-3 226,80	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,752	EUR	14 500 000	-1 544,69	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,769	EUR	20 000 000	-3 240,13	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,773	EUR	5 000 000	-453,93	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,793	EUR	50 000 000	-4 212,86	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,796	EUR	9 000 000	-740,44	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,8	EUR	2 000 000	-156,86	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,800	EUR	25 000 000	-1 989,67	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,803	EUR	25 000 000	-3 508,00	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,814	EUR	50 000 000	-2 064,58	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,825	EUR	4 000 000	-206,33	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,829	EUR	11 000 000	-2 118,87	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,847	EUR	12 500 000	-378,23	0,00



• CARTERA DE TÍTULOS DETALLADA A 29/12/2022 EN EUR (continuación)

Denominación de los valores	Divisa	Cantidad n.º o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
OISEST/0,0/FIX/1,85	EUR	15 000 000	-1 584,07	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,86	EUR	7 000 000	-209,47	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,86	EUR	5 000 000	-727,19	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,873	EUR	30 000 000	640,65	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,881	EUR	8 000 000	-1 279,73	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,882	EUR	25 000 000	-3 383,19	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,884	EUR	13 000 000	-1 818,30	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,895	EUR	50 000 000	-7 031,00	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,905	EUR	50 000 000	-2 464,00	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,905	EUR	50 000 000	-4 772,55	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,913	EUR	16 500 000	-630,77	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,916	EUR	4 000 000	-275,12	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,932	EUR	14 500 000	-845,13	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,94	EUR	50 000 000	-7 261,55	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,946	EUR	10 000 000	-647,29	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,957	EUR	21 000 000	-2 161,55	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,957	EUR	20 000 000	-2 058,62	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,958	EUR	8 000 000	-834,56	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,96	EUR	14 000 000	-1 524,26	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,972	EUR	25 000 000	-5 333,80	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,974	EUR	2 000 000	-436,15	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,974	EUR	21 000 000	-5 474,94	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,986	EUR	8 000 000	-613,89	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,988	EUR	50 000 000	-11 468,47	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,988	EUR	15 000 000	-1 211,66	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,993	EUR	10 000 000	-140,92	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,997	EUR	20 000 000	-598,23	0,00
OISEST/0,0/FIX/1,998	EUR	8 000 000	-845,78	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,005	EUR	50 000 000	11 231,67	0,01
OISEST/0,0/FIX/2,008	EUR	50 000 000	4 955,25	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,012	EUR	30 000 000	-1 266,17	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,046	EUR	25 000 000	-519,50	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,048	EUR	8 500 000	-1 150,12	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,055	EUR	5 000 000	-77,04	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,062	EUR	25 000 000	-8 960,00	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,063	EUR	5 000 000	-73,60	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,07	EUR	50 000 000	1 370,44	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,072	EUR	50 000 000	-510,83	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,107	EUR	10 000 000	887,28	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,11	EUR	50 000 000	-4 980,97	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,132	EUR	27 000 000	1 185,18	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,143	EUR	9 000 000	51,01	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,147	EUR	25 000 000	-1 385,20	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,176	EUR	50 000 000	119 221,16	0,01
OISEST/0,0/FIX/2,182	EUR	35 000 000	-5 060,52	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,189	EUR	4 000 000	36,97	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,206	EUR	50 000 000	362,09	0,00



• CARTERA DE TÍTULOS DETALLADA A 29/12/2022 EN EUR (continuación)

Denominación de los valores	Divisa	Cantidad n.º o nominal	Valor actual	% del patrimonio neto
OISEST/0,0/FIX/2,23	EUR	25 000 000	-4 620,57	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,238	EUR	50 000 000	5 903,08	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,273	EUR	50 000 000	388,34	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,281	EUR	25 000 000	6 316,44	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,306	EUR	30 000 000	7 098,94	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,312	EUR	25 000 000	9 605,55	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,330	EUR	15 000 000	8 061,06	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,333	EUR	10 000 000	3 728,32	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,337	EUR	22 000 000	8 879,55	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,348	EUR	7 000 000	-416,33	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,36	EUR	25 000 000	12 130,50	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,408	EUR	25 000 000	49 238,41	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,492	EUR	25 000 000	35 415,07	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,531	EUR	25 000 000	63 666,12	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,576	EUR	25 000 000	84 122,22	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,619	EUR	27 100 000	142 375,81	0,00
OISEST/0,0/FIX/2,62	EUR	25 000 000	78 098,45	0,00
OISESTR/0/FIX/1,375	EUR	14 000 000	-64,86	0,00
TOTAL Swaps de tipos			6 493 672,52	0,06
TOTAL Otros instrumentos financieros a plazo			6 493 672,52	0,06
TOTAL Instrumento financiero a plazo			6 493 672,52	0,06
Créditos			0,12	0,00
Deudas			-9 434 481,73	-0,09
Cuentas financieras			969 024 802,31	9,20
Patrimonio neto			10 538 462 704,68	100,00



NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL

43, avenue Pierre Mendès-France - CS 41432 - 75648 Paris cedex 13 Francia - Tel.: 01 78 40 80 00

Sociedad anónima con un capital de 51 371 060,28 euros

Inscrita en el Registro Mercantil de París con el n.º 329 450 738 - APE 6630Z - IVA: FR 203 294 507 38