RCS : PARIS
Code greffe : 7501

Documents comptables

REGISTRE DU COMMERCE ET DES SOCIETES

Le greffier du tribunal de commerce de PARIS atteste l'exactitude des informations transmises ci-après

Nature du document : Documents comptables (B-S)

Numéro de gestion : 1987 B 12833
Numéro SIREN : 343 217 782
Nom ou dénomination : NATIXIS SECURITE JOUR

Ce dépôt a été enregistré le 28/09/2018 sous le numéro de dépôt 95089

DEPOT DES COMPTES ANNUELS

DATE DEPOT : 28-09-2018

N° DE DEPOT : 095089

N° GESTION : 1987B12833

N° SIREN : 343217782

DENOMINATION : NATIXIS SECURITE JOUR

ADRESSE : 43 avenue Pierre Mendès France Immeuble Eléments 75013 Paris

MILLESIME : 2018

NATIXIS SECURITE JOUR

Société d'Investissement à Capital Variable

COMPTES CLOS LE 29 JUIN 2018

BILAN
HORS BILAN
COMPTE DE RESULTAT
ANNEXES
INVENTAIRE

Copie certifiée conforme

Siège Social : 43 avenue Pierre Mendès France – 75013 PARIS
R.C.S.PARIS : B 343 217 782

NATIXIS SECURITE JOUR

COMPTES ANNUELS

29/06/2018

BILAN ACTIF AU 29/06/2018 EN EUR

	29/06/2018	30/06/2017
Instruments financiers	**131 302 993,61**	**142 948 588,87**
OPC Maître	**131 302 993,61**	**142 948 588,87**
Instruments financiers à terme	**0,00**	**0,00**
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Autres opérations	0,00	0,00
Créances	**0,00**	**0,00**
Opérations de change à terme de devises	**0,00**	**0,00**
Autres	**0,00**	**0,00**
Comptes financiers	**185,38**	**535,67**
Liquidités	**185,38**	**535,67**
Total de l'actif	**131 303 178,99**	**142 949 124,54**

BILAN PASSIF AU 29/06/2018 EN EUR

	29/06/2018	30/06/2017
Capitaux propres		
Capital	**131 638 215,80**	**143 189 272,98**
Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées (a)	**0,00**	**0,00**
Report à nouveau (a)	**0,00**	**0,00**
Plus et moins-values nettes de l'exercice (a, b)	**-318 643,60**	**-218 434,45**
Résultat de l'exercice (a, b)	**-16 047,84**	**-20 816,83**
Total des capitaux propres (= Montant représentatif de l'actif net)	**131 303 524,36**	**142 950 021,70**
Instruments financiers	**0,00**	**0,00**
Instruments financiers à terme	**0,00**	**0,00**
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Autres opérations	0,00	0,00
Dettes	**-345,37**	**-897,16**
Opérations de change à terme de devises	**0,00**	**0,00**
Autres	**-345,37**	**-897,16**
Comptes financiers	**0,00**	**0,00**
Concours bancaires courants	**0,00**	**0,00**
Emprunts	**0,00**	**0,00**
Total du passif	**131 303 178,99**	**142 949 124,54**

(a) Y compris comptes de régularisation
(b) Diminués des acomptes versés au titre de l'exercice

HORS-BILAN AU 29/06/2018 EN EUR

	29/06/2018	30/06/2017
Opérations de couverture		
Engagement sur marchés réglementés ou assimilés		
Engagement sur marché de gré à gré		
Autres engagements		
Autres opérations		
Engagement sur marchés réglementés ou assimilés		
Engagement sur marché de gré à gré		
Autres engagements		

COMPTE DE RÉSULTAT AU 29/06/2018 EN EUR

	29/06/2018	30/06/2017
Produits sur opérations financières		
Produits sur dépôts et sur comptes financiers	0,00	0,00
Produits sur actions et valeurs assimilées	0,00	0,00
Produits sur obligations et valeurs assimilées	0,00	0,00
Produits sur titres de créances	0,00	0,00
Produits sur acquisitions et cessions temporaires de titres	0,00	0,00
Produits sur instruments financiers à terme	0,00	0,00
Autres produits financiers	0,00	0,00
Total (1)	**0,00**	**0,00**
Charges sur opérations financières		
Charges sur acquisitions et cessions temporaires de titres	0,00	0,00
Charges sur instruments financiers à terme	0,00	0,00
Charges sur dettes financières	0,51	2,94
Autres charges financières	0,00	0,00
Total (2)	**0,51**	**2,94**
Résultat sur opérations financières (1 - 2)	**-0,51**	**-2,94**
Autres produits (3)	0,00	0,00
Frais de gestion et dotations aux amortissements (4)	17 874,98	29 870,04
Résultat net de l'exercice (L. 214-17-1) (1 - 2 + 3 - 4)	**-17 875,49**	**-29 872,98**
Régularisation des revenus de l'exercice (5)	1 827,65	9 056,15
Acomptes sur résultat versés au titre de l'exercice (6)	0,00	0,00
Résultat (1 - 2 + 3 - 4 + 5 - 6)	**-16 047,84**	**-20 816,83**

ANNEXES AUX COMPTES ANNUELS

1. REGLES ET METHODES COMPTABLES

Les comptes annuels sont présentés sous la forme prévue par le Règlement ANC 2014-01 abrogeant le Règlement CRC 2003-02 modifié. Ce règlement intègre la nouvelle classification AIFM des OPC, mais ne modifie pas les principes comptables applicables ni les méthodes d'évaluation des actifs et passifs.

Les principes généraux de la comptabilité s'appliquent :
- image fidèle, comparabilité, continuité de l'activité,
- régularité, sincérité,
- prudence,
- permanence des méthodes d'un exercice à l'autre.

La devise de référence de la comptabilité du portefeuille est en EURO.
La durée de l'exercice est de 12 mois.

Règles d'évaluation des actifs

Les titres détenus dans le portefeuille de la SICAV nourricière sont évalués sur la dernière valeur liquidative connue du Fonds maître FR0010831693 NATIXIS CASH EURIBOR.I 4D

Frais de gestion

Les frais de gestion sont calculés à chaque valorisation sur l'actif net.
Ces frais sont imputés au compte de résultat de l'OPC.
Les frais de gestion sont intégralement versés à la société de gestion qui prend en charge l'ensemble des frais de fonctionnement des OPC.
Les frais de gestion n'incluent pas les frais de transaction.

Le taux appliqué est de 0.10% ttc annuel et est appliqué sur la base de l'actif net

Le taux des frais de gestion réellement appliqué tient compte des mesures exceptionnelles mise en œuvre en raison des conditions de marché et plus particulièrement du niveau des taux courts durant l'exercice.

Abandon des FDG à hauteur de 130 693.66 euros sur l'exercice.

Affectation des sommes distribuables

Définition des sommes distribuables :

Les sommes distribuables sont constituées par :

Le résultat :

Le résultat net de l'exercice est égal au montant des intérêts, arrérages, primes et lots, dividendes, jetons de présence et tous autres produits relatifs aux titres constituant le portefeuille, majorés du produit des sommes momentanément disponibles et diminué du montant des frais de gestion et de la charge des emprunts.
Il est augmenté du report à nouveau et majoré ou diminué du solde du compte de régularisation des revenus.

Les Plus et Moins-values :

Les plus-values réalisées, nettes de frais, diminuées des moins-values réalisées, nettes de frais, constatées au cours de l'exercice, augmentées des plus-values nettes de même nature constatées au cours d'exercices antérieurs n'ayant pas fait l'objet d'une distribution ou d'une capitalisation et diminuées ou augmentées du solde du compte de régularisation des plus-values.

Modalités d'affectation des sommes distribuables :

Sommes Distribuables	***Action***
Affectation du résultat net	Capitalisation
Affectation des plus ou moins-values nettes réalisées	Capitalisation

2. EVOLUTION DE L'ACTIF NET AU 29/06/2018 EN EUR

	29/06/2018	30/06/2017
Actif net en début d'exercice	**142 950 021,70**	**168 162 817,74**
Souscriptions (y compris les commissions de souscription acquises à l'OPC)	535 070 109,77	1 176 100 173,56
Rachats (sous déduction des commissions de rachat acquises à l'OPC)	-546 238 374,03	-1 200 940 934,02
Plus-values réalisées sur dépôts et instruments financiers	0,00	0,01
Moins-values réalisées sur dépôts et instruments financiers	-349 658,25	-280 214,30
Plus-values réalisées sur instruments financiers à terme	0,00	0,00
Moins-values réalisées sur instruments financiers à terme	0,00	0,00
Frais de transactions	0,00	0,00
Différences de change	0,00	0,00
Variations de la différence d'estimation des dépôts et instruments financiers	-110 699,34	-61 948,31
Différence d'estimation exercice N	-177 167,39	-66 468,05
Différence d'estimation exercice N-1	66 468,05	4 519,74
Variations de la différence d'estimation des instruments financiers à terme	0,00	0,00
Différence d'estimation exercice N	0,00	0,00
Différence d'estimation exercice N-1	0,00	0,00
Distribution de l'exercice antérieur sur plus et moins-values nettes	0,00	0,00
Distribution de l'exercice antérieur sur résultat	0,00	0,00
Résultat net de l'exercice avant compte de régularisation	-17 875,49	-29 872,98
Acompte(s) versé(s) au cours de l'exercice sur plus et moins-values nettes	0,00	0,00
Acompte(s) versé(s) au cours de l'exercice sur résultat	0,00	0,00
Autres éléments	0,00	0,00
Actif net en fin d'exercice	**131 303 524,36**	**142 950 021,70**

3. COMPLEMENTS D'INFORMATION

3.1. VENTILATION PAR NATURE JURIDIQUE OU ECONOMIQUE DES INSTRUMENTS FINANCIERS

	Montant	%
Hors-bilan		
Opérations de couverture		
TOTAL Opérations de couverture	**0,00**	**0,00**
Autres opérations		
TOTAL Autres opérations	**0,00**	**0,00**

3.2. VENTILATION PAR NATURE DE TAUX DES POSTES D'ACTIF, DE PASSIF ET DE HORS BILAN

	Taux fixe	%	Taux variable	%	Taux révisable	%	Autres	%
Hors-bilan								
Opérations de couverture	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Autres opérations	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

3.3. VENTILATION PAR MATURITE RESIDUELLE DES POSTES D'ACTIF, DE PASSIF ET DE HORS BILAN

	< 3 mois	%	]3 mois - 1 an]	%	]1 - 3 ans]	%	]3 - 5 ans]	%	> 5 ans	%
Hors-bilan										
Opérations de couverture	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Autres opérations	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

Les positions à terme de taux sont présentées en fonction de l'échéance du sous-jacent.

3.4. VENTILATION PAR DEVISE DE COTATION OU D'EVALUATION DES POSTES D'ACTIF, DE PASSIF ET DE HORS BILAN

							Autres devises	
	Montant	%	Montant	%	Montant	%	Montant	%
Actif								
OPC Maître	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Créances	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Comptes financiers	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Passif								
Comptes financiers	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Hors-bilan								
Opérations de couverture	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Autres opérations	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

3.5. CRÉANCES ET DETTES : VENTILATION PAR NATURE

	29/06/2018
Créances	
Total des créances	**0,00**
Dettes	
Frais de gestion	-345,37
Total des dettes	**-345,37**

3.6. CAPITAUX PROPRES

3.6.1. Nombre de titres émis ou rachetés

	En actions	En montant
Actions souscrites durant l'exercice	9 432,9	535 070 109,77
Actions rachetées durant l'exercice	-9 630,5	-546 238 374,03
Solde net des souscriptions/rachats	-197,6	-11 168 264,26

3.6.2. Commissions de souscription et/ou rachat

	En montant
Total des commissions acquises	0,00
Commissions de souscription acquises	0,00
Commissions de rachat acquises	0,00

3.7. FRAIS DE GESTION

	29/06/2018
Commissions de garantie	0,00
Frais de gestion fixes	17 874,98
Pourcentage de frais de gestion fixes	0,01
Frais de gestion variables	0,00
Rétrocessions des frais de gestion	0,00

3.8. ENGAGEMENTS REÇUS ET DONNES

3.8.1. Garanties reçues par l'OPC :

Néant

3.8.2. Autres engagements reçus et/ou donnés :

Néant

3.9. AUTRES INFORMATIONS

3.9.1. Valeur actuelle des titres faisant l'objet d'une acquisition temporaire

	29/06/2018
Titres pris en pension livrée	0,00
Titres empruntés	0,00

3.9.2. Valeur actuelle des titres constitutifs de dépots de garantie

	29/06/2018
Instruments financiers donnés en garantie et maintenus dans leur poste d'origine	0,00
Instruments financiers reçus en garantie et non inscrits au bilan	0,00

3.9.3. Instruments financiers du groupe détenus en portefeuille

	Code Isin	Libellés	29/06/2018
Actions			0,00
Obligations			0,00
TCN			0,00
OPC			131 302 993,61
	FR0010831693	NATIXIS CASH EURIBOR I	131 302 993,61
Instruments financiers à terme			0,00

3.10. TABLEAU D'AFFECTATION DES SOMMES DISTRIBUABLES

Tableau d'affectation de la quote-part des sommes distribuables afférente au résultat

	29/06/2018	30/06/2017
Sommes restant à affecter		
Report à nouveau	0,00	0,00
Résultat	-16 047,84	-20 816,83
Total	**-16 047,84**	**-20 816,83**

	29/06/2018	30/06/2017
NATIXIS SECURITE JOUR		
Affectation		
Distribution	0,00	0,00
Report à nouveau de l'exercice	0,00	0,00
Capitalisation	-16 047,84	-20 816,83
Total	**-16 047,84**	**-20 816,83**

Tableau d'affectation de la quote-part des sommes distribuables afférente aux plus et moins-values nettes

	29/06/2018	30/06/2017
Sommes restant à affecter		
Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées	0,00	0,00
Plus et moins-values nettes de l'exercice	-318 643,60	-218 434,45
Acomptes versés sur plus et moins-values nettes de l'exercice	0,00	0,00
Total	**-318 643,60**	**-218 434,45**

	29/06/2018	30/06/2017
NATIXIS SECURITE JOUR		
Affectation		
Distribution	0,00	0,00
Plus et moins-values nettes non distribuées	0,00	0,00
Capitalisation	-318 643,60	-218 434,45
Total	**-318 643,60**	**-218 434,45**

3.11. TABLEAU DES RÉSULTATS ET AUTRES ÉLÉMENTS CARACTÉRISTIQUES DE L'ENTITÉ AU COURS DES CINQ DERNIERS EXERCICES

	30/09/2014	30/09/2015	30/06/2016	30/06/2017	29/06/2018
Actif net Global en EUR	**553 456 076,13**	**296 200 968,62**	**168 162 817,74**	**142 950 021,70**	**131 303 524,36**
Actif net en EUR	553 456 076,13	296 200 968,62	168 162 817,74	142 950 021,70	131 303 524,36
Nombre de titres	9 728,0	5 204,7	2 955,0	2 516,7	2 319,1
Valeur liquidative unitaire en EUR	56 893,09	56 910,28	56 907,89	56 800,58	56 618,31
Capitalisation unitaire sur plus et moins-values nettes en EUR	120,51	49,46	13,61	-86,79	-137,39
Capitalisation unitaire en EUR sur résultat	-29,77	-2,41	-6,20	-8,27	-6,91

3.12. INVENTAIRE EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
NATIXIS CASH EURIBOR I	EUR	1 280,2539	131 302 993,61	100,00
TOTAL FRANCE			**131 302 993,61**	**100,00**
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			**131 302 993,61**	**100,00**
TOTAL Organismes de placement collectif			**131 302 993,61**	**100,00**
Créances			**345,37**	**0,00**
Comptes financiers			**185,38**	**0,00**
Actif net			**131 303 524,36**	**100,00**

NATIXIS SECURITE JOUR	**EUR**	**2 319,1**	**56 618,31**

NATIXIS CASH EURIBOR

COMPTES ANNUELS

29/06/2018

BILAN ACTIF AU 29/06/2018 EN EUR

	29/06/2018	30/06/2017
Immobilisations nettes	**0,00**	**0,00**
Dépôts	**0,00**	**0,00**
Instruments financiers	**6 510 820 909,77**	**7 063 148 067,89**
Actions et valeurs assimilées	**0,00**	**0,00**
Négociées sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Non négociées sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Obligations et valeurs assimilées	**1 007 686 382,13**	**695 128 226,14**
Négociées sur un marché réglementé ou assimilé	1 007 686 382,13	695 128 226,14
Non négociées sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Titres de créances	**4 847 768 114,04**	**5 709 656 055,98**
Négociés sur un marché réglementé ou assimilé	3 972 767 381,18	5 709 656 055,98
Titres de créances négociables	*3 972 767 381,18*	*5 700 158 232,60*
Autres titres de créances	*0,00*	*9 497 823,38*
Non négociés sur un marché réglementé ou assimilé	875 000 732,86	0,00
Organismes de placement collectif	**29 797 304,01**	**4 605 314,27**
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays	29 797 304,01	4 605 314,27
Autres Fonds destinés à des non professionnels et équivalents d'autres pays Etats membres de l'UE	0,00	0,00
Fonds professionnels à vocation générale et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations cotés	0,00	0,00
Autres Fonds d'investissement professionnels et équivalents d'autres Etats membres de l'UE et organismes de titrisations non cotés	0,00	0,00
Autres organismes non européens	0,00	0,00
Opérations temporaires sur titres	**622 754 898,47**	**652 024 227,07**
Créances représentatives de titres reçus en pension	0,00	0,00
Créances représentatives de titres prêtés	622 754 898,47	652 024 227,07
Titres empruntés	0,00	0,00
Titres donnés en pension	0,00	0,00
Autres opérations temporaires	0,00	0,00
Instruments financiers à terme	**2 814 211,12**	**1 734 244,43**
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Autres opérations	2 814 211,12	1 734 244,43
Autres instruments financiers	**0,00**	**0,00**
Créances	**13 385 467,03**	**843 370,20**
Opérations de change à terme de devises	**0,00**	**0,00**
Autres	**13 385 467,03**	**843 370,20**
Comptes financiers	**373 374 915,14**	**635 865 716,43**
Liquidités	**373 374 915,14**	**635 865 716,43**
Total de l'actif	**6 897 581 291,94**	**7 699 857 154,52**

BILAN PASSIF AU 29/06/2018 EN EUR

	29/06/2018	30/06/2017
Capitaux propres		
Capital	**6 912 591 033,56**	**7 702 028 904,47**
Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées (a)	**0,00**	**0,00**
Report à nouveau (a)	**0,00**	**0,00**
Plus et moins-values nettes de l'exercice (a, b)	**-27 266 091,22**	**-22 621 308,76**
Résultat de l'exercice (a, b)	**2 316 808,38**	**10 924 887,45**
Total des capitaux propres (= Montant représentatif de l'actif net)	**6 887 641 750,72**	**7 690 332 483,16**
Instruments financiers	**7 727 745,36**	**935 641,20**
Opérations de cession sur instruments financiers	**0,00**	**0,00**
Opérations temporaires sur titres	**0,00**	**0,00**
Dettes représentatives de titres donnés en pension	0,00	0,00
Dettes représentatives de titres empruntés	0,00	0,00
Autres opérations temporaires	0,00	0,00
Instruments financiers à terme	**7 727 745,36**	**935 641,20**
Opérations sur un marché réglementé ou assimilé	0,00	0,00
Autres opérations	7 727 745,36	935 641,20
Dettes	**2 166 589,56**	**8 544 838,49**
Opérations de change à terme de devises	**0,00**	**0,00**
Autres	**2 166 589,56**	**8 544 838,49**
Comptes financiers	**45 206,30**	**44 191,67**
Concours bancaires courants	**45 206,30**	**44 191,67**
Emprunts	**0,00**	**0,00**
Total du passif	**6 897 581 291,94**	**7 699 857 154,52**

(a) Y compris comptes de régularisation
(b) Diminués des acomptes versés au titre de l'exercice

HORS-BILAN AU 29/06/2018 EN EUR

	29/06/2018	30/06/2017
Opérations de couverture		
Engagement sur marchés réglementés ou assimilés		
Engagement sur marché de gré à gré		
Swaps de taux		
E3M/0.005/FIX/0.0	100 000 000,00	0,00
E3M/0.066/FIX/0.0	22 000 000,00	0,00
E3M/0.142/FIX/0.0	80 000 000,00	0,00
E3M/0.175/FIX/0.0	0,00	40 000 000,00
E3M/0.257/FIX/0.0	0,00	80 000 000,00
E3M/0.26/FIX/0.0	25 000 000,00	0,00
E3R 0.0975/FIX 0	27 000 000,00	0,00
E3R 0.237/FIX 0	10 000 000,00	0,00
E3R/0.019/FIX/0.0	50 000 000,00	0,00
E3R/0.0365/FIX/0.0	80 000 000,00	0,00
E3R/0.045/FIX/0.0	75 000 000,00	0,00
E3R/0.049/FIX/0.0	25 000 000,00	0,00
E3R/0.051/FIX/0.0	30 000 000,00	0,00
E3R/0.053/FIX/0.0	18 000 000,00	0,00
E3R/0.055/FIX/0.0	40 000 000,00	0,00
E3R/0.057/FIX/0.0	42 000 000,00	0,00
E3R/0.058/FIX/0.0	50 000 000,00	0,00
E3R/0.086/FIX/0.0	65 000 000,00	0,00
E3R/0.09/FIX/0.0	0,00	82 000 000,00
E3R/0.1075/FIX/0.0	0,00	70 000 000,00
E3R/0.128/FIX/0.0	50 000 000,00	0,00
E3R/0.137/FIX/0.0	50 000 000,00	0,00
E3R/0.137/FIX/0.0	24 500 000,00	0,00
E3R/0.1475/FIX/0.0	100 000 000,00	0,00
E3R/0.171/FIX/0.0	25 000 000,00	0,00
E3R/0.18/FIX/0.0	0,00	33 500 000,00
E3R/0.18/FIX/0.0	0,00	39 000 000,00
E3R/0.185/FIX/0.0	25 000 000,00	0,00
E3R/0.235/FIX/0.0	20 000 000,00	0,00
E3R/0.238/FIX/0.0	0,00	25 000 000,00
E3R/0.2405/FIX/0.0	0,00	50 000 000,00
E3R/0.241/FIX/0.0	13 000 000,00	0,00
E3R/0.248/FIX/0.0	0,00	70 000 000,00
E3R/0.25/FIX/0.0	0,00	43 500 000,00
E3R/0.253/FIX/0.0	8 000 000,00	0,00

HORS-BILAN AU 29/06/2018 EN EUR

	29/06/2018	30/06/2017
E3R/0.259/FIX/0.0	0,00	15 000 000,00
E3R/0.296/FIX/0.0	0,00	50 000 000,00
E3r/0.3085/FIX/0.0	42 000 000,00	0,00
E3R/0.309/FIX/0.0	10 000 000,00	0,00
E3R/0.328/FIX/0.0	0,00	40 000 000,00
E3R/0.328/FIX/0.0	0,00	49 000 000,00
E3R/0.329/FIX/0.0	0,00	40 000 000,00
FIX /EON+0.4075	0,00	50 000 000,00
OIS 0.19/FIX 0	0,00	20 000 000,00
OIS 0.542/FIX	0,00	75 000 000,00
OIS/0.0/FIX/-0.36	0,00	50 000 000,00
OIS/0.053/FIX/0.0	0,00	50 000 000,00
OIS/0.081/FIX/0.0	0,00	4 000 000,00
OIS/0.0819/FIX/0.0	13 000 000,00	0,00
OIS/0.087/FIX/0.0	0,00	6 000 000,00
OIS/0.095/FIX/0.0	0,00	48 000 000,00
OIS/0.101/FIX/0.0	0,00	7 500 000,00
OIS/0.114/FIX/0.0	30 000 000,00	0,00
OIS/0.116/FIX/0.0	11 000 000,00	0,00
OIS/0.16/FIX/0.0	5 000 000,00	0,00
OIS/0.161/FIX/0.0	0,00	73 000 000,00
OIS/0.171/FIX/0.0	16 000 000,00	0,00
OIS/0.18/FIX/0.0	0,00	70 000 000,00
OIS/0.186/FIX/0.0	0,00	30 000 000,00
OIS/0.274/FIX/0.0	6 000 000,00	0,00
OIS/0.334/FIX/0.0	0,00	70 000 000,00
OIS/0.3455/FIX/0.0	0,00	70 000 000,00
OIS/0.347/FIX/0.0	0,00	63 000 000,00
OIS/0.3475/FIX/0.0	0,00	16 000 000,00
OIS/0.373/FIX/0.0	0,00	80 000 000,00
OIS/0.3775/FIX/5.375	0,00	4 844 262,30
OIS/0.384/FIX/0.0	0,00	7 000 000,00
OIS/0.39/FIX/0.0	0,00	5 000 000,00
OIS/0.431/FIX/0.0	0,00	50 000 000,00
Swaps de devises		
E3R/0.171/FIX/2.22	37 735 849,05	0,00
E3R/0.171/FIX/2.22	42 881 646,55	0,00
E3R/0.171/FIX/2.4	42 358 523,00	0,00
E3R/0.171/FIX/2.4	42 358 523,00	0,00

HORS-BILAN AU 29/06/2018 EN EUR

	29/06/2018	30/06/2017
E3R/0.208/FIX/2.92	49 939 098,64	0,00
FIX/-0.053/FIX/0.125	4 919 323,10	0,00
OIS/0.319/FIX/0.0	0,00	44 385 264,09
OIS/0.33/FIX/0.0	33 853 836,06	0,00
OIS/0.3325/FIX/0.0	25 673 940,95	0,00
OIS/0.335/FIX/0.0	47 133 430,45	0,00
Autres engagements		
Autres opérations		
Engagement sur marchés réglementés ou assimilés		
Engagement sur marché de gré à gré		
Autres engagements		

COMPTE DE RÉSULTAT AU 29/06/2018 EN EUR

	29/06/2018	30/06/2017
Produits sur opérations financières		
Produits sur dépôts et sur comptes financiers	110 990,10	195 198,55
Produits sur actions et valeurs assimilées	0,00	0,00
Produits sur obligations et valeurs assimilées	14 782 066,78	17 303 440,92
Produits sur titres de créances	-788 690,85	839 398,41
Produits sur acquisitions et cessions temporaires de titres	327 912,21	310 554,45
Produits sur instruments financiers à terme	1 026 283,80	689 629,54
Autres produits financiers	0,00	0,00
Total (1)	**15 458 562,04**	**19 338 221,87**
Charges sur opérations financières		
Charges sur acquisitions et cessions temporaires de titres	12 454,98	3 131,39
Charges sur instruments financiers à terme	8 398 336,08	1 429 183,94
Charges sur dettes financières	575 949,24	1 025 665,89
Autres charges financières	0,00	0,00
Total (2)	**8 986 740,30**	**2 457 981,22**
Résultat sur opérations financières (1 - 2)	**6 471 821,74**	**16 880 240,65**
Autres produits (3)	0,00	0,00
Frais de gestion et dotations aux amortissements (4)	3 933 388,09	5 122 248,12
Résultat net de l'exercice (L. 214-17-1) (1 - 2 + 3 - 4)	**2 538 433,65**	**11 757 992,53**
Régularisation des revenus de l'exercice (5)	-221 625,27	-833 105,08
Acomptes sur résultat versés au titre de l'exercice (6)	0,00	0,00
Résultat (1 - 2 + 3 - 4 + 5 - 6)	**2 316 808,38**	**10 924 887,45**

ANNEXES AUX COMPTES ANNUELS

REGLES ET METHODES COMPTABLES

Les comptes annuels sont présentés sous la forme prévue par le Règlement ANC 2014-01 abrogeant le Règlement CRC 2003-02 modifié.

Les principes généraux de la comptabilité s'appliquent :
- image fidèle, comparabilité, continuité de l'activité,
- régularité, sincérité,
- prudence,
- permanence des méthodes d'un exercice à l'autre.

Le mode de comptabilisation retenu pour l'enregistrement des produits des titres à revenu fixe est celui des intérêts courus .

Les entrées et les cessions de titres sont comptabilisées frais exclus.
La devise de référence de la comptabilité du portefeuille est en EURO.
La durée de l'exercice est de 12 mois.

Règles d'évaluation des actifs

Les instruments financiers sont enregistrés en comptabilité selon la méthode des coûts historiques et inscrits au bilan à leur valeur actuelle qui est déterminée par la dernière valeur de marché connue ou à défaut d'existence de marché par tous moyens externes ou par recours à des modèles financiers.
Les différences entre les valeurs actuelles utilisées lors du calcul de la valeur liquidative et les coûts historiques des valeurs mobilières à leur entrée en portefeuille sont enregistrées dans des comptes « différences d'estimation ».
Les valeurs qui ne sont pas dans la devise du portefeuille sont évaluées conformément au principe énoncé ci-dessous, puis converties dans la devise du portefeuille suivant le cours des devises au jour de l'évaluation.

Dépôts :

Les dépôts d'une durée de vie résiduelle inférieure ou égale à 3 mois sont valorisés selon la méthode linéaire.

Actions, obligations et autres valeurs négociées sur un marché réglementé ou assimilé :

Les actions et autres valeurs négociées sur un marché réglementé ou assimilé sont valorisées au cours d'ouverture du jour appelé J des marchés soit en fonction de zone d'appartenance du marché :
- Zone Asie : cours de clôture J des marchés
- Zone Europe : cours d'ouverture J
- Zone Amérique : cours de clôture (J-1)

Les obligations et valeurs assimilées sont évaluées au cours d'ouverture communiqués par différents prestataires de services financiers.
Les intérêts courus des obligations sont calculés jusqu'à la date de la valeur liquidative.

Actions, obligations et autres valeurs non négociées sur un marché réglementé ou assimilé :

Les valeurs non négociées sur un marché réglementé sont évaluées sous la responsabilité du Conseil d'Administration en utilisant des méthodes fondées sur la valeur patrimoniale et le rendement, en prenant en considération les prix retenus lors de transactions significatives récentes.

Titres de créances négociables :

Les Titres de Créances Négociables et assimilés qui ne font pas l'objet de transactions significatives sont évalués de façon actuarielle sur la base d'un taux de référence défini ci-dessous, majoré le cas échéant d'un écart représentatif des caractéristiques intrinsèques de l'émetteur :
TCN dont l'échéance est inférieure ou égale à 1 an : Taux interbancaire offert en euros (Euribor) ;
TCN dont l'échéance est supérieure à 1 an : Taux des Bons du Trésor à intérêts Annuels Normalisés (BTAN) ou taux de l'OAT (Obligations Assimilables du Trésor) de maturité proche pour les durées les plus longues.

Les Titres de Créances Négociables d'une durée de vie résiduelle inférieure ou égale à 3 mois pourront être évalués selon la méthode linéaire.

Les Bons du Trésor sont valorisés au taux du marché communiqué quotidiennement par la Banque de France.

OPC détenus :

Les parts ou actions d'OPC seront valorisées à la dernière valeur liquidative connue.

Opérations temporaires sur titres :

Les titres reçus en pension sont inscrits à l'actif dans la rubrique « créances représentatives des titres reçus en pension » pour le montant prévu dans le contrat, majoré des intérêts courus à recevoir.

Les titres donnés en pension sont inscrits en portefeuille acheteur pour leur valeur actuelle. La dette représentative des titres donnés en pension est inscrite en portefeuille vendeur à la valeur fixée au contrat majorée des intérêts courus à payer.

Les titres prêtés sont valorisés à leur valeur actuelle et sont inscrits à l'actif dans la rubrique « créances représentatives de titres prêtés » à la valeur actuelle majorée des intérêts courus à recevoir.

Les titres empruntés sont inscrits à l'actif dans la rubrique « titres empruntés » pour le montant prévu dans le contrat, et au passif dans la rubrique « dettes représentatives de titres empruntés » pour le montant prévu dans le contrat majoré des intérêts courus à payer.

Instruments financiers à terme :

Instruments financiers à terme négociés sur un marché réglementé ou assimilé :

Les instruments financiers à terme négociés sur les marchés réglementés ou assimilés sont valorisés pour le calcul de la valeur liquidative du jour (J) :
- Zone Asie : au cours de compensation du jour
- Zone Europe : au cours d'ouverture du jour (J)
- Zone Amérique : au cours de compensation de (J –1)

Instruments financiers à terme non négociés sur un marché réglementé ou assimilé :

Les swaps :

Les contrats d'échange de taux d'intérêt et/ou de devises sont valorisés à leur valeur de marché en fonction du prix calculé par actualisation des flux d'intérêts futurs aux taux d'intérêts et/ou de devises de marché. Ce prix est corrigé du risque de signature.

Les swaps d'indice sont évalués de façon actuarielle sur la base d'un taux de référence fourni par la contrepartie.

Les autres swaps sont évalués à leur valeur de marché ou à une valeur estimée selon les modalités arrêtées par le Conseil d'Administration.

Engagements Hors Bilan :

Les contrats à terme ferme sont portés pour leur valeur de marché en engagements hors bilan au cours utilisé dans le portefeuille.
Les opérations à terme conditionnelles sont traduites en équivalent sous-jacent.
Les engagements sur contrats d'échange sont présentés à leur valeur nominale, ou en l'absence de valeur nominale pour un montant équivalent.

Frais de gestion

Les frais de gestion et de fonctionnement recouvrent l'ensemble des frais relatif à l'OPC : gestion financière, administrative, comptable, conservation, distribution, frais d'audit…
Ces frais sont imputés au compte de résultat de l'OPC.
Les frais de gestion n'incluent pas les frais de transaction. Pour plus de précision sur les frais effectivement facturés à l'OPC, se reporter au prospectus.

Ils sont enregistrés au prorata temporis à chaque calcul de valeur liquidative.

Le cumul de ces frais respecte le taux de frais maximum :

Montant annuel maximum des frais de gestion Part R :
0,25 % TTC de l''actif net hors OPC. Ces frais sont directement imputés au compte de résultat du fonds.

Montant annuel maximum des frais de gestion Part I :
0,20 % TTC de l''actif net hors OPC. Ces frais sont directement imputés au compte de résultat du fonds.

Montant annuel maximum des frais de gestion Part RE :
0,50 % TTC de l''actif net hors OPC. Ces frais sont directement imputés au compte de résultat du fonds.

Le taux des frais de gestion réellement appliqué tient compte des mesures exceptionnelles mises en œuvre en raison des conditions de marché et plus particulièrement du niveau des taux courts durant l'exercice.

Modalités de calcul de la commission de surperformance :

La commission de surperformance, applicable à une catégorie d'action donnée est basée sur la comparaison entre l'actif valorisé de la SICAV et l'actif de référence.
L'actif valorisé de la SICAV s'entend comme la quote-part de l'actif, correspondant à une catégorie d'action, évalué selon les règles de valorisation applicables aux actifs et après prise en compte des frais de fonctionnement et de gestion réels correspondant à ladite catégorie d'action.
L'actif de référence représente la quote-part de l'actif de la SICAV, correspondant à une catégorie d'action donnée, retraité des montants de souscriptions/rachats applicable à ladite catégorie d'action à chaque valorisation, et le cas échéant valorisé selon la performance de l'indice de référence retenu.
L'indice de référence, retenu pour le calcul de la commission de surperformance, est : l'EONIA capitalisé.
La période d'observation correspond à :
- Pour la première période d'observation : du 7 octobre 2013 au 30 juin 2015
- Pour les périodes suivantes : du 1er juillet de l'exercice concerné au 30 juin de l'année suivante.

Si, sur la période d'observation, l'actif valorisé de la SICAV est supérieur à celui de l'actif de référence défini ci-dessus, la part variable des frais de gestion représentera 30% TTC maximum de l'écart entre ces deux actifs.
Si, sur la période d'observation, l'actif valorisé de la SICAV est inférieur à celui de l'actif de référence, la part variable des frais de gestion sera nulle.
Si, sur la période d'observation, l'actif valorisé de la SICAV est supérieur à celui de l'actif de référence, cet écart fera l'objet d'une provision au titre des frais de gestion variables lors du calcul de la valeur liquidative.
Dans le cas où l'actif valorisé de la SICAV est inférieur à celui de l'actif de référence entre deux valeurs liquidatives, toute provision passée précédemment sera réajustée par une reprise sur provision. Les reprises sur provisions sont plafonnées à hauteur des dotations antérieures.
En cas de sous performance et de risque de baisse de la valeur liquidative, on appliquera un taux de reprise de 100% pour ramener la valeur liquidative au niveau de celle de la veille puis au-delà, on appliquera un taux de 30% de l'écart de performance entre l'objectif de performance et zéro.
Cette part variable ne pourra être acquise à la clôture comptable que si, sur la période écoulée, l'actif valorisé de la SICAV est supérieur à celui de l'actif de référence constaté lors de la dernière valeur liquidative de la période de référence. Tout ou partie de cette part variable acquise pourra faire l'objet d'un report sur l'exercice suivant. La provision ne sera définitivement perçue par la société de gestion qu'à la clôture de l'exercice suivant, sauf si celle-ci a, entre-temps, fait l'objet de reprises de provision au titre de cet exercice.

Affectation des sommes distribuables

Définition des sommes distribuables :

Les sommes distribuables sont constituées par :

Le résultat :

Le résultat net de l'exercice est égal au montant des intérêts, arrérages, primes et lots, dividendes, jetons de présence et tous autres produits relatifs aux titres constituant le portefeuille, majorés du produit des sommes momentanément disponibles et diminué du montant des frais de gestion et de la charge des emprunts.
Il est augmenté du report à nouveau et majoré ou diminué du solde du compte de régularisation des revenus.

Les Plus et Moins-values :

Les plus-values réalisées, nettes de frais, diminuées des moins-values réalisées, nettes de frais, constatées au cours de l'exercice, augmentées des plus-values nettes de même nature constatées au cours d'exercices

antérieurs n'ayant pas fait l'objet d'une distribution ou d'une capitalisation et diminuées ou augmentées du solde du compte de régularisation des plus-values.

Modalités d'affectation des sommes distribuables :

Sommes Distribuables	*Parts IC / RC / RE*
Affectation du résultat net	Capitalisation
Affectation des plus ou moins-values nettes réalisées	Capitalisation

2. EVOLUTION DE L'ACTIF NET AU 29/06/2018 EN EUR

	29/06/2018	30/06/2017
Actif net en début d'exercice	**7 690 332 483,16**	**7 639 191 183,11**
Souscriptions (y compris les commissions de souscription acquises à l'OPC)	30 052 077 471,02	53 724 933 262,23
Rachats (sous déduction des commissions de rachat acquises à l'OPC)	-30 831 389 234,81	-53 658 970 355,66
Plus-values réalisées sur dépôts et instruments financiers	682 332,78	97 970,14
Moins-values réalisées sur dépôts et instruments financiers	-31 273 949,94	-21 271 994,84
Plus-values réalisées sur instruments financiers à terme	6 106 142,63	4 320 208,68
Moins-values réalisées sur instruments financiers à terme	-27 309 023,18	-4 540 176,30
Frais de transactions	-41 480,36	-36 557,97
Différences de change	72 294 040,87	4 245 685,69
Variations de la différence d'estimation des dépôts et instruments financiers	2 168 932,49	-5 927 087,63
Différence d'estimation exercice N	-4 739 039,43	-6 907 971,92
Différence d'estimation exercice N-1	6 907 971,92	980 884,29
Variations de la différence d'estimation des instruments financiers à terme	-48 544 347,59	-3 467 596,82
Différence d'estimation exercice N	-52 373 394,56	-3 829 046,97
Différence d'estimation exercice N-1	3 829 046,97	361 450,15
Distribution de l'exercice antérieur sur plus et moins-values nettes	0,00	0,00
Distribution de l'exercice antérieur sur résultat	0,00	0,00
Résultat net de l'exercice avant compte de régularisation	2 538 433,65	11 757 992,53
Acompte(s) versé(s) au cours de l'exercice sur plus et moins-values nettes	0,00	0,00
Acompte(s) versé(s) au cours de l'exercice sur résultat	0,00	0,00
Autres éléments *	-50,00	-50,00
Actif net en fin d'exercice	**6 887 641 750,72**	**7 690 332 483,16**

* Autres éléments N et N-1 : Frais d'attribution d'un identifiant d'entité juridique et frais de certification annuelle d'un LEI : 50 €.

3. COMPLEMENTS D'INFORMATION

3.1. VENTILATION PAR NATURE JURIDIQUE OU ECONOMIQUE DES INSTRUMENTS FINANCIERS

	Montant	%
Actif		
Obligations et valeurs assimilées		
Obligations à taux fixe négociées sur un marché réglementé ou assimilé	302 149 213,59	4,39
Obligations à taux. VAR / REV négociées sur un marché réglementé ou assimilé	705 537 168,54	10,24
TOTAL Obligations et valeurs assimilées	**1 007 686 382,13**	**14,63**
Titres de créances		
Titres négociables à court terme (NEU CP) émetteurs non fin. Étr. europeens marché non	853 817 530,63	12,40
Titres négociables à court terme (NEU CP) émis par des émetteurs bancaires	1 687 749 963,49	24,50
Titres négociables à court terme (NEU CP) émis par des émetteurs non financiers	2 134 952 727,96	31,00
Titres négociables à moyen terme (NEU MTN)	150 064 689,73	2,18
US commercial paper	21 183 202,23	0,31
TOTAL Titres de créances	**4 847 768 114,04**	**70,38**
Passif		
Opérations de cession sur instruments financiers		
TOTAL Opérations de cession sur instruments financiers	**0,00**	**0,00**
Hors-bilan		
Opérations de couverture		
Change	326 854 170,80	4,75
Taux	1 187 500 000,00	17,24
TOTAL Opérations de couverture	**1 514 354 170,80**	**21,99**
Autres opérations		
TOTAL Autres opérations	**0,00**	**0,00**

3.2. VENTILATION PAR NATURE DE TAUX DES POSTES D'ACTIF, DE PASSIF ET DE HORS BILAN

	Taux fixe	%	Taux variable	%	Taux révisable	%	Autres	%
Actif								
Dépôts	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Obligations et valeurs assimilées	302 149 213,59	4,39	149 825 616,33	2,18	555 711 552,21	8,07	0,00	0,00
Titres de créances	3 842 905 243,66	55,79	804 946 584,27	11,69	199 916 286,11	2,90	0,00	0,00
Opérations temporaires sur titres	395 755 345,74	5,75	135 299 130,86	1,96	91 700 421,87	1,33	0,00	0,00
Comptes financiers	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	373 374 915,14	5,42
Passif								
Opérations temporaires sur titres	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Comptes financiers	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	45 206,30	0,00
Hors-bilan								
Opérations de couverture	1 187 500 000,00	17,24	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Autres opérations	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

3.3. VENTILATION PAR MATURITE RESIDUELLE DES POSTES D'ACTIF, DE PASSIF ET DE HORS BILAN

	< 3 mois	%	]3 mois - 1 an]	%	]1 - 3 ans]	%	]3 - 5 ans]	%	> 5 ans	%
Actif										
Dépôts	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Obligations et valeurs assimilées	417 413 386,54	6,06	590 272 995,59	8,57	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Titres de créances	3 036 055 825,74	44,08	1 741 672 196,52	25,29	70 040 091,78	1,02	0,00	0,00	0,00	0,00
Opérations temporaires sur titres	188 366 857,75	2,73	434 388 040,72	6,31	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Comptes financiers	373 374 915,14	5,42	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Passif										
Opérations temporaires sur titres	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Comptes financiers	45 206,30	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Hors-bilan										
Opérations de couverture	390 500 000,00	5,67	797 000 000,00	11,57	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Autres opérations	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

Les positions à terme de taux sont présentées en fonction de l'échéance du sous-jacent.

3.4. VENTILATION PAR DEVISE DE COTATION OU D'EVALUATION DES POSTES D'ACTIF, DE PASSIF ET DE HORS BILAN

	CHF		GBP		DKK		**Autres devises**	
	Montant	**%**	**Montant**	**%**	**Montant**	**%**	**Montant**	**%**
Actif								
Dépôts	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Actions et valeurs assimilées	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Obligations et valeurs assimilées	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	91 580 145,23	1,33
Titres de créances	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	238 758 519,70	3,47
OPC	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Opérations temporaires sur titres	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Créances	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Comptes financiers	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Passif								
Opérations de cession sur instruments financiers	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Opérations temporaires sur titres	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00
Comptes financiers	18 442,64	0,00	15 609,94	0,00	7 379,61	0,00	3 774,11	0,00
Hors-bilan								
Opérations de couverture	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	326 854 170,80	4,75
Autres opérations	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00

3.5. CRÉANCES ET DETTES : VENTILATION PAR NATURE

	29/06/2018
Créances	
Collatéraux	13 385 467,03
Total des créances	**13 385 467,03**
Dettes	
Frais de gestion	185 036,72
Frais de gestion variable	1 625 627,25
Collatéraux	355 925,59
Total des dettes	**2 166 589,56**

3.6. CAPITAUX PROPRES

3.6.1. Nombre de titres émis ou rachetés

	En actions	En montant
NATIXIS CASH EURIBOR R		
Actions souscrites durant l'exercice	55 035,1944	2 281 150 458,09
Actions rachetées durant l'exercice	-62 438,5307	-2 587 849 606,26
Solde net des souscriptions/rachats	-7 403,3363	-306 699 148,17
NATIXIS CASH EURIBOR I		
Actions souscrites durant l'exercice	270 346,4350	27 770 927 012,93
Actions rachetées durant l'exercice	-274 953,0091	-28 243 538 641,68
Solde net des souscriptions/rachats	-4 606,5741	-472 611 628,75
NATIXIS CASH EURIBOR RE		
Actions souscrites durant l'exercice	0,0000	0,00
Actions rachetées durant l'exercice	-0,9720	-986,87
Solde net des souscriptions/rachats	-0,9720	-986,87

3.6.2. Commissions de souscription et/ou rachat

	En montant
NATIXIS CASH EURIBOR R	
Commissions de rachat acquises	0,00
Commissions de souscription acquises	0,00
Total des commissions acquises	**0,00**
NATIXIS CASH EURIBOR I	
Commissions de rachat acquises	0,00
Commissions de souscription acquises	0,00
Total des commissions acquises	**0,00**
NATIXIS CASH EURIBOR RE	
Commissions de rachat acquises	0,00
Commissions de souscription acquises	0,00
Total des commissions acquises	**0,00**

3.7. FRAIS DE GESTION

	29/06/2018
NATIXIS CASH EURIBOR R	
Commissions de garantie	0,00
Frais de gestion fixes	447 215,65
Pourcentage de frais de gestion fixes	0,07
Frais de gestion variables	3 740,91
Rétrocessions des frais de gestion	0,00

3.7.FRAIS DE GESTION

	29/06/2018
NATIXIS CASH EURIBOR I	
Commissions de garantie	0,00
Frais de gestion fixes	3 425 153,72
Pourcentage de frais de gestion fixes	0,05
Frais de gestion variables	56 977,47
Rétrocessions des frais de gestion	0,00
NATIXIS CASH EURIBOR RE	
Commissions de garantie	0,00
Frais de gestion fixes	42,99
Pourcentage de frais de gestion fixes	0,07
Frais de gestion variables	0,45
Rétrocessions des frais de gestion	0,00

3.8. ENGAGEMENTS REÇUS ET DONNES

3.8.1. Garanties reçues par l'OPC :

Néant

3.8.2. Autres engagements reçus et/ou donnés :

Néant

3.9. AUTRES INFORMATIONS

3.9.1. Valeur actuelle des titres faisant l'objet d'une acquisition temporaire

	29/06/2018
Titres pris en pension livrée	0,00
Titres empruntés	0,00

3.9.2. Valeur actuelle des titres constitutifs de dépots de garantie

	29/06/2018
Instruments financiers donnés en garantie et maintenus dans leur poste d'origine	0,00
Instruments financiers reçus en garantie et non inscrits au bilan	0,00

3.9.3. Instruments financiers du groupe détenus en portefeuille

	Code Isin	Libellés	29/06/2018
Actions			0,00
Obligations			0,00
TCN			299 550 852,42
	666685436INF	BPCE E3R+0.05% 14-08-18	99 967 397,22
	666685727INF	BPCE 210918 OIS 0.105	99 810 327,42
	666685408INF	NATIXIS 100818 OIS 0.1	99 773 127,78
OPC			29 797 304,01
	FR0010322438	OSTRUM CASH A1P1 IC	29 684 742,87
	FR0010731463	OSTRUM CASH A1P1 ID	112 561,14
Instruments financiers à terme			42 000 000,00
	SWP020665802	E3r/0.3085/FIX/0.0	42 000 000,00

3.10. TABLEAU D'AFFECTATION DES SOMMES DISTRIBUABLES

Tableau d'affectation de la quote-part des sommes distribuables afférente au résultat

	29/06/2018	30/06/2017
Sommes restant à affecter		
Report à nouveau	0,00	0,00
Résultat	2 316 808,38	10 924 887,45
Total	**2 316 808,38**	**10 924 887,45**

	29/06/2018	30/06/2017
NATIXIS CASH EURIBOR R		
Affectation		
Distribution	0,00	0,00
Report à nouveau de l'exercice	0,00	0,00
Capitalisation	64 042,14	952 721,38
Total	**64 042,14**	**952 721,38**

	29/06/2018	30/06/2017
NATIXIS CASH EURIBOR I		
Affectation		
Distribution	0,00	0,00
Report à nouveau de l'exercice	0,00	0,00
Capitalisation	2 252 758,10	9 972 083,78
Total	**2 252 758,10**	**9 972 083,78**

	29/06/2018	30/06/2017
NATIXIS CASH EURIBOR RE		
Affectation		
Distribution	0,00	0,00
Report à nouveau de l'exercice	0,00	0,00
Capitalisation	8,14	82,29
Total	**8,14**	**82,29**

Tableau d'affectation de la quote-part des sommes distribuables afférente aux plus et moins-values nettes

	29/06/2018	30/06/2017
Sommes restant à affecter		
Plus et moins-values nettes antérieures non distribuées	0,00	0,00
Plus et moins-values nettes de l'exercice	-27 266 091,22	-22 621 308,76
Acomptes versés sur plus et moins-values nettes de l'exercice	0,00	0,00
Total	**-27 266 091,22**	**-22 621 308,76**

	29/06/2018	30/06/2017
NATIXIS CASH EURIBOR R		
Affectation		
Distribution	0,00	0,00
Plus et moins-values nettes non distribuées	0,00	0,00
Capitalisation	-1 642 092,48	-2 123 265,15
Total	**-1 642 092,48**	**-2 123 265,15**

	29/06/2018	30/06/2017
NATIXIS CASH EURIBOR I		
Affectation		
Distribution	0,00	0,00
Plus et moins-values nettes non distribuées	0,00	0,00
Capitalisation	-25 623 765,28	-20 497 863,28
Total	**-25 623 765,28**	**-20 497 863,28**

	29/06/2018	30/06/2017
NATIXIS CASH EURIBOR RE		
Affectation		
Distribution	0,00	0,00
Plus et moins-values nettes non distribuées	0,00	0,00
Capitalisation	-233,46	-180,33
Total	**-233,46**	**-180,33**

3.11. TABLEAU DES RÉSULTATS ET AUTRES ÉLÉMENTS CARACTÉRISTIQUES DE L'ENTITÉ AU COURS DES CINQ DERNIERS EXERCICES

	30/06/2014	30/06/2015	30/06/2016	30/06/2017	29/06/2018
Actif net Global en EUR	**7 135 521 799,30**	**6 154 014 042,47**	**7 639 191 183,11**	**7 690 332 483,16**	**6 887 641 750,72**
NATIXIS CASH EURIBOR R					
Actif net en EUR	2 633 672 926,08	1 547 767 926,39	1 603 913 813,56	732 083 775,06	423 327 310,09
Nombre de titres	63 372,4337	37 209,3228	38 557,9484	17 631,4282	10 228,0919
Valeur liquidative unitaire en EUR	41 558,65	41 596,24	41 597,48	41 521,52	41 388,68
Capitalisation unitaire sur plus et moins-values nettes en EUR	-0,88	-70,21	-28,46	-120,42	-160,54
Capitalisation unitaire en EUR sur résultat	99,94	83,60	52,61	54,03	6,26
NATIXIS CASH EURIBOR I					
Actif net en EUR	4 501 734 609,91	4 606 129 600,20	6 035 159 646,65	6 958 187 173,90	6 464 254 088,31
Nombre de titres	43 742,7681	44 702,9492	58 561,3076	67 635,4968	63 028,9227
Valeur liquidative unitaire en EUR	102 913,80	103 038,60	103 057,11	102 877,74	102 560,12
Capitalisation unitaire sur plus et moins-values nettes en EUR	-2,18	-173,89	-70,73	-303,06	-406,53
Capitalisation unitaire en EUR sur résultat	286,13	238,77	145,95	147,43	35,74
NATIXIS CASH EURIBOR RE					
Actif net en EUR	114 263,31	116 515,88	117 722,90	61 534,20	60 352,32
Nombre de titres	112,3240	114,4434	115,6254	60,5484	59,5764
Valeur liquidative unitaire en EUR	1 017,26	1 018,10	1 018,14	1 016,28	1 013,02
Capitalisation unitaire sur plus et moins-values nettes en EUR	-0,01	-1,71	-0,69	-2,97	-3,91
Capitalisation unitaire en EUR sur résultat	1,89	1,96	1,28	1,35	0,13

3.12. INVENTAIRE EN EUR

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Obligations et valeurs assimilées				
Obligations et valeurs assimilées négociées sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
DAIM E3R+0.53% 12-01-19 EMTN	EUR	3 500 000	3 510 190,83	0,05
DPW 1.5% 09/10/2018	EUR	10 224 000	10 382 731,80	0,15
SAP E3R+0.3% 20-11-18 EMTN	EUR	23 575 000	23 601 521,88	0,35
SAP SE E3R+0.3% 23-08-18 EMTN	EUR	12 500 000	12 505 525,00	0,18
TOTAL ALLEMAGNE			**49 999 969,51**	**0,73**
AUTRICHE				
OMVAV 0.6 11/19/18	EUR	4 530 000	4 561 266,93	0,07
TOTAL AUTRICHE			**4 561 266,93**	**0,07**
BELGIQUE				
ANHEUSERBUSCH INBEV E3R+0.25% 19-10-18	EUR	22 213 000	22 232 991,70	0,32
B E3R+0.55% 14-09-18 EMTN	EUR	34 400 000	34 439 908,78	0,50
TOTAL BELGIQUE			**56 672 900,48**	**0,82**
ESPAGNE				
SANT CONS FIN 1.1% 30-07-18	EUR	53 900 000	54 504 112,68	0,79
TOTAL ESPAGNE			**54 504 112,68**	**0,79**
ETATS UNIS AMERIQUE				
G E3R+0.65% 11-09-18 EMTN	EUR	21 889 000	21 915 437,05	0,32
GOLD SACH GR E3R+0.46% 31-12-18	EUR	56 250 000	56 346 612,50	0,82
INTESA SPA NEW YORK BRANCH 2.4% 14-01-19	USD	100 000 000	86 785 719,38	1,26
3M E3R+0.23% 09-11-18 EMTN	EUR	3 500 000	3 503 745,00	0,05
TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE			**168 551 513,93**	**2,45**
FRANCE				
AUCHAN SA 3.625% 19/10/18 SERIE EMTN	EUR	2 500 000	2 591 988,36	0,04
CAPGEMINI E3R+0.85% 02-07-18	EUR	50 500 000	50 565 045,40	0,72
FRANCE TELECOM 4.125% 23/01/2019 SERIE EMTN	EUR	1 000 000	1 042 194,18	0,02
GROUPE DANONE E3R+0.15% 03-11-18	EUR	71 700 000	71 772 775,50	1,03
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE E3R+0.1% 26-11-18	EUR	9 712 000	9 724 916,96	0,14
R E3R+0.58% 16-07-18 EMTN	EUR	109 375 000	109 456 690,97	1,58
RCI BANQUE E3R+1.0% 18-03-19 EMTN	EUR	12 079 000	12 157 576,24	0,18
SANOFI E3R+0.23% 10-09-18 EMTN	EUR	10 000 000	10 005 916,70	0,15
SCHNEIDER ELECTRIC SA 3.75% 12/07/2018 SERIE EMTN	EUR	6 400 000	6 639 711,12	0,10
SCHNEIDER ELECTRIC 3.5% 22/01/19	EUR	7 000 000	7 254 677,26	0,11
ST GOBAIN 4% 08/10/18 EMTN	EUR	7 310 000	7 608 618,51	0,11
STE EURIBOR 3 MOIS REV +0.75 31/03/2019	EUR	7 500 000	7 533 252,50	0,11
TOTAL FRANCE			**296 353 363,70**	**4,29**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ITALIE				
UCGIM 3 5/8 01/24/19	EUR	7 500 000	7 773 140,86	0,11
TOTAL ITALIE			**7 773 140,86**	**0,11**
LUXEMBOURG				
PURPLE PROTECTED ASSET OIS+0.0% 11-12-18	EUR	100 000 000	99 858 869,61	1,45
PURPLE PROTECTED ASSET OIS+0.05% 19-02-19	EUR	50 000 000	49 966 746,72	0,73
TOTAL LUXEMBOURG			**149 825 616,33**	**2,18**
NORVEGE				
SANT CONS BAN 1.0% 25-02-19	EUR	5 500 000	5 558 613,80	0,08
TOTAL NORVEGE			**5 558 613,80**	**0,08**
PAYS-BAS				
BMW FIN E3R+0.3% 17-10-18 EMTN	EUR	5 100 000	5 104 666,50	0,07
BMW FIN 0.5% 05-09-18 EMTN	EUR	10 931 000	10 991 764,23	0,16
BMW FINANCE 3.25% 14/01/2019	EUR	5 000 000	5 170 544,52	0,08
BMW FINANCE 5%03-18 EMTN	EUR	4 947 000	5 195 495,20	0,08
BRENNTAG FINANCE BV 5.5% 19/07/2018	EUR	4 200 000	4 431 312,23	0,06
IBERDROLA INTL BV 4.25% 11/10/2018	EUR	21 000 000	21 909 999,04	0,32
N E3R+0.37% 16-10-18 EMTN	EUR	10 500 000	10 510 201,33	0,15
R E3R+0.7% 06-07-18 EMTN	EUR	11 200 000	11 211 004,07	0,16
RWE FINANCE 5 1/8%03-18 EMTN	EUR	9 333 000	9 812 631,82	0,14
TERM F E3R+0.45% 09-08-18	EUR	750 000	750 421,47	0,01
V E3R+0.3% 16-07-18 EMTN	EUR	3 116 000	3 116 327,18	0,05
TOTAL PAYS-BAS			**88 204 367,59**	**1,28**
ROYAUME UNI				
ABBEY NATIONAL TREASURY 2% 01/19	EUR	1 300 000	1 327 515,12	0,02
BG ENERGY 3% 11/18	EUR	3 100 000	3 196 061,36	0,05
FCE BANK E3R+1.18% 11-08-18 EMTN	EUR	29 522 000	29 593 691,72	0,43
IMPERAIL TOBACCO FIN. 4.5% 05/07/2018	EUR	15 800 000	16 511 393,73	0,24
N E3R+0.5% 02-11-18 EMTN	EUR	28 190 000	28 240 882,95	0,41
NATGRID TR 5% 02/07/18 *EUR	EUR	19 500 000	20 472 328,77	0,30
VODAFONE E3R+0.95% 25-02-19 EMTN	EUR	17 300 000	17 412 007,41	0,25
TOTAL ROYAUME UNI			**116 753 881,06**	**1,70**
SUEDE				
V E3R+0.42% 03-08-18 EMTN	EUR	500 000	500 242,57	0,01
VATTENFALL TREASURY 6.75% 01/19	EUR	3 400 000	3 632 966,84	0,05
VOLVO TREASURY AB 0.125% 24-08-18	SEK	50 000 000	4 794 425,85	0,07
TOTAL SUEDE			**8 927 635,26**	**0,13**
TOTAL Obligations & val. ass. ng. sur mar. régl. ou ass.			**1 007 686 382,13**	**14,63**
TOTAL Obligations et valeurs assimilées			**1 007 686 382,13**	**14,63**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Titres de créances				
Titres de créances négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
ALLEMAGNE				
VOLKSWAGEN BANK GMBH 031218 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 015 523,58	0,36
VOLKSWAGEN BANK GMBH 070918 FIX 0.0	EUR	6 000 000	6 001 415,29	0,09
TOTAL ALLEMAGNE			**31 016 938,87**	**0,45**
BELGIQUE				
BELFIUS BANK 170918 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 035 322,10	0,72
ENI FINANCE INTERNATIONAL S.A. 160818 FIX 0.0	EUR	26 853 973,13	26 862 900,02	0,39
PROXIMUS 270718 FIX 0.0	EUR	15 000 000	15 003 544,51	0,22
TOTAL BELGIQUE			**91 901 766,63**	**1,33**
ESPAGNE				
SANTANDER CONSUMER FINANCE S.A 010219 FIX 0.0	EUR	80 000 000	80 128 751,49	1,16
TOTAL ESPAGNE			**80 128 751,49**	**1,16**
ETATS UNIS AMERIQUE				
AT AND T INC 280519 FIX 0.0	USD	40 000 000	33 317 630,94	0,48
AT AND T INC 300519 FIX 0.0	USD	85 000 000	70 787 832,07	1,03
HONEYWELL INTERNATIONAL INC 141118 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 011 262,67	0,15
HONEYWELL INTERNATIONAL INC 230818 FIX 0.0	EUR	9 000 000	9 002 097,78	0,13
HONEYWELL INTERNATIONAL INC 240918 FIX 0.0	EUR	18 000 000	18 014 292,82	0,26
INTE SANP SPA 2.92% 10-05-19	USD	61 500 000	53 015 733,80	0,77
INTESA SANPAOLO SPA NEW YORK BRANCH 151118 FIX 2.2	USD	94 000 000	81 637 322,89	1,19
UNITED TECHNOLOGIES CORP 150818 FIX 0.0	EUR	40 000 000	40 014 188,06	0,58
UNITED TECHNOLOGIES CORP 190718 FIX 0.0	EUR	19 000 000	19 002 782,71	0,28
WHIRLPOOL CORP 110718 FIX 0.0	EUR	7 000 000	7 000 498,87	0,10
TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE			**341 803 642,61**	**4,97**
FRANCE				
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 090818 FIX 0.0	EUR	15 000 000	15 005 943,32	0,22
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 100718 FIX 0.0	EUR	14 500 000	14 500 822,20	0,21
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 100818 FIX 0.0	EUR	19 750 000	19 758 031,38	0,29
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 161118 FIX 0.0	EUR	35 000 000	35 019 603,88	0,51
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 170918 FIX 0.0	EUR	15 000 000	15 005 113,03	0,22
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 181018 FIX 0.0	EUR	11 000 000	11 005 117,38	0,16
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 191118 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 002 844,39	0,07
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 200718 FIX 0.0	EUR	9 300 000	9 300 755,02	0,14
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 210918 FIX 0	EUR	16 000 000	16 006 666,23	0,23
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 250918 FIX 0.0	EUR	2 000 000	2 000 756,82	0,03
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 260718 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 000 900,63	0,07
AGACHE (SOCIETE FINANCIERE) 281118 FIX 0	EUR	9 000 000	9 005 359,74	0,13
ATOS SE 130718 FIX 0.0	EUR	24 500 000	24 501 162,17	0,36

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ATOS SE 210818 FIX 0.0	EUR	6 000 000	6 001 876,08	0,09
AUCHAN HOLDING SA 140918 FIX 0.0	EUR	11 000 000	11 007 014,94	0,16
AUCHAN HOLDING SA 141218 FIX 0.0	EUR	15 000 000	15 015 291,82	0,22
AUCHAN HOLDING SA 201118 FIX 0.0	EUR	13 000 000	13 014 272,66	0,19
AUCHAN HOLDING SA 240918 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 015 761,23	0,36
AUCHAN HOLDING SA 240918 OIS 0.07	EUR	10 000 000	9 992 752,61	0,15
AUCHAN HOLDING SA 250918 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 002 023,11	0,07
AUCHAN HOLDING SA 260718 FIX 0.0	EUR	13 000 000	13 002 861,08	0,19
AUCHAN HOLDING SA 270718 FIX 0.0	EUR	19 000 000	19 004 488,02	0,28
BARCLAYS BANQUE PLC (FRANCE) 050918 FIX	EUR	80 000 000	80 024 597,95	1,15
BARCLAYS BANQUE PLC (FRANCE) 180119 FIX 0.0	EUR	66 000 000	66 049 316,82	0,96
BFCM (BANQUE FE 290719 OIS 0.14	EUR	70 000 000	70 040 091,78	1,02
BNP PARIBAS 110718 FIX 0.0	EUR	100 000 000	100 007 768,26	1,44
BNP PARIBAS 120718 OIS 0.08	EUR	50 000 000	49 863 829,75	0,72
BPCE E3R+0.05% 14-08-18	EUR	100 000 000	99 967 397,22	1,44
BPCE 040119 E3R 0.06	EUR	100 000 000	99 948 888,89	1,44
BPCE 110119 OIS 0.08	EUR	163 000 000	162 786 747,10	2,35
BPCE 210918 OIS 0.105	EUR	100 000 000	99 810 327,42	1,44
BPCE 240519 OIS 0.1	EUR	70 000 000	69 988 915,34	1,02
CAPGEMINI SE 221018 FIX 0.0	EUR	12 000 000	12 005 748,35	0,17
CFCM MAINE ANJOU BASSE NORMANDIE 211218 OIS 0.08	EUR	27 000 000	26 999 412,14	0,39
CFCM MAINE ANJOU BASSE NORMANDIE 250718 OIS 0.02	EUR	25 000 000	24 962 112,22	0,36
COFACE HOLDING 050918 FIX 0.0	EUR	5 500 000	5 502 682,98	0,08
COFACE HOLDING 060818 FIX 0.0	EUR	2 500 000	2 500 912,36	0,04
COFACE 120918 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 005 904,45	0,15
COFACE 280818 FIX 0.0	EUR	8 000 000	8 004 754,71	0,12
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN 011018 FIX 0.0	EUR	19 000 000	19 012 976,74	0,28
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN 191018 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 008 515,30	0,15
COMPAGNIE DE SAINT GOBAIN 310718 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 002 417,92	0,15
CREDIT LYONNAIS 110918 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 015 295,91	0,36
ENGIE SA 020818 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 006 205,71	0,29
ENGIE SA 060818 OIS 0.01	EUR	25 000 000	24 963 621,98	0,36
ENGIE SA 160718 OIS 0.01	EUR	6 000 000	5 990 047,64	0,09
ENGIE SA 280918 OIS 0.015	EUR	15 000 000	14 977 522,96	0,22
GROUPE DANONE 130718 FIX 0.0	EUR	1 500 000	1 500 163,23	0,02
GROUPE DANONE 170918 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 005 196,55	0,15
GROUPE DANONE 200718 FIX 0.0	EUR	19 000 000	19 003 385,18	0,28
GROUPE DANONE 240718 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 000 496,27	0,07
GROUPE DANONE 241018 FIX 0.0	EUR	15 000 000	15 015 167,82	0,22

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
ILIAD 140918 FIX 0.0	EUR	5 500 000	5 501 792,68	0,08
ILIAD 160818 FIX 0.0	EUR	9 000 000	9 001 818,77	0,13
ILIAD 161118 FIX 0.0	EUR	7 500 000	7 504 200,83	0,11
ILIAD 211218 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 015 537,60	0,36
ILIAD 310818 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 002 669,46	0,15
KLEPIERRE 030918 FIX 0.0	EUR	30 000 000	30 017 076,99	0,44
KLEPIERRE 060918 FIX 0.0	EUR	8 400 000	8 405 162,99	0,12
KLEPIERRE 120918 FIX 0.0	EUR	6 000 000	6 004 023,45	0,09
KLEPIERRE 180918 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 007 264,56	0,15
KLEPIERRE 190918 FIX 0.0	EUR	13 500 000	13 509 932,88	0,20
KLEPIERRE 210918 FIX 0.0	EUR	17 000 000	17 012 824,73	0,25
KLEPIERRE 230718 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 000 977,91	0,07
KLEPIERRE 250718 FIX 0.0	EUR	8 000 000	8 001 738,43	0,12
KLEPIERRE 260718 FIX 0.0	EUR	36 000 000	36 008 167,02	0,52
KLEPIERRE 280918 FIX 0.0	EUR	13 000 000	13 010 177,12	0,19
KLEPIERRE 300718 FIX 0.0	EUR	7 000 000	7 001 824,84	0,10
KLEPIERRE 310818 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 027 105,85	0,73
L' AIR LIQUIDE 151018 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 018 976,32	0,29
MICHELIN-MICHELIN ET CIE (GLE) 120718 FIX 0.0	EUR	6 000 000	6 000 508,46	0,09
MICHELIN-MICHELIN ET CIE (GLE) 120918 FIX 0.0	EUR	7 000 000	7 004 273,33	0,10
MICHELIN-MICHELIN ET CIE (GLE) 140918 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 006 274,49	0,15
MICHELIN-MICHELIN ET CIE (GLE) 180918 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 006 830,50	0,15
MICHELIN-MICHELIN ET CIE (GLE) 200718 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 001 550,40	0,15
MICHELIN-MICHELIN ET CIE (GLE) 260718 FIX 0.0	EUR	30 000 000	30 006 201,60	0,44
NATIXIS FACTOR SA 201218 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 008 138,10	0,07
NATIXIS LEASE IMMO 280319 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 007 112,32	0,07
NATIXIS LEASE SA 141218 OIS 0.14	EUR	5 000 000	4 995 401,63	0,07
NATIXIS 100818 OIS 0.1	EUR	100 000 000	99 773 127,78	1,44
ORANGE SA 050718 FIX 0.0	EUR	22 000 000	22 000 623,50	0,32
PERNOD RICARD 130718 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 001 023,88	0,15
PERNOD RICARD 190918 FIX 0.0	EUR	8 500 000	8 505 786,95	0,12
PERNOD RICARD 211118 FIX 0.0	EUR	12 000 000	12 006 900,43	0,17
PERNOD RICARD 220818 FIX 0.0	EUR	7 500 000	7 503 455,02	0,11
PERNOD RICARD 221018 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 002 395,15	0,07
PERNOD RICARD 250718 FIX 0.0	EUR	8 000 000	8 001 712,70	0,12
RENA CRED INTE BAN ZCP 24-07-18	EUR	10 000 000	10 002 293,94	0,15
RENAULT CREDIT 070818 FIX 0.0	EUR	2 800 000	2 800 826,45	0,04
RENAULT CREDIT 270818 FIX 0.0	EUR	100 000 000	100 047 482,26	1,44
SAFRAN EX SAGEM SA 050918 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 028 460,41	0,73

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
SCHNEIDER ELECTRIC SE 050718 FIX 0.0	EUR	14 000 000	14 000 379,27	0,20
SCHNEIDER ELECTRIC SE 170718 FIX 0.0	EUR	19 000 000	19 002 733,63	0,28
SCHNEIDER ELECTRIC SE 260718 FIX 0.0	EUR	18 000 000	18 003 963,31	0,26
SCHNEIDER ELECTRIC SE 270718 FIX 0.0	EUR	15 000 000	15 003 440,37	0,22
SEB SA 180718 FIX 0.0	EUR	23 500 000	23 503 502,02	0,34
SEB SA 180918 FIX 0.0	EUR	4 000 000	4 002 645,46	0,06
SEB SA 180918 FIX 0.0	EUR	2 600 000	2 601 719,49	0,04
SOCIETE DES AU 050718 FIX 0.0	EUR	6 000 000	6 000 167,58	0,09
SOCIETE DES AU 070918 FIX 0.0	EUR	14 000 000	14 008 214,11	0,20
SOCIETE GENERALE 310519 OIS 0.1	EUR	50 000 000	50 001 482,89	0,73
SODEXO 170918 FIX 0.0	EUR	10 500 000	10 507 755,11	0,15
SODEXO 250718 FIX 0.0	EUR	4 500 000	4 500 465,86	0,07
SUEZ 021018 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 022 669,82	0,36
SUEZ 030818 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 002 668,63	0,15
SUEZ 050918 FIX 0.0	EUR	6 000 000	6 003 198,03	0,09
SUEZ 151018 FIX 0.0	EUR	11 000 000	11 011 385,31	0,16
SUEZ 161118 FIX 0.0	EUR	14 000 000	14 018 912,49	0,20
SUEZ 221118 FIX 0.0	EUR	42 000 000	42 042 596,21	0,61
TECHNIP EUROCASH SNC 130918 FIX 0.0	EUR	4 000 000	4 002 313,35	0,06
TECHNIP EUROCASH SNC 250918 FIX 0.0	EUR	8 000 000	8 005 387,25	0,12
TECHNIP 040918 FIX 0.0	EUR	38 000 000	38 017 237,90	0,55
TECHNIP 050918 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 009 214,34	0,29
VALEO SA 050918 FIX 0.0	EUR	26 000 000	26 014 094,14	0,38
VALEO SA 090718 FIX 0.0	EUR	14 000 000	14 000 809,22	0,20
VALEO SA 270718 FIX 0.0	EUR	45 000 000	45 009 588,08	0,65
VEOL ENVI SA ZCP 09-07-18	EUR	26 000 000	26 001 598,50	0,38
VEOL ENVI SA ZCP 16-07-18	EUR	5 500 000	5 500 676,33	0,08
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 040718 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 000 423,72	0,36
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 040918 FIX 0.0	EUR	11 000 000	11 005 755,31	0,16
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 050918 FIX 0.0	EUR	6 000 000	6 003 200,36	0,09
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 061218 FIX 0.0	EUR	18 000 000	18 020 043,48	0,26
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 100718 FIX 0.0	EUR	4 000 000	4 000 280,80	0,06
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 100918 FIX 0.0	EUR	17 000 000	17 009 758,91	0,25
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 141218 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 013 585,10	0,15
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 180918 FIX 0.0	EUR	12 000 000	12 007 805,99	0,17
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 181018 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 045 821,04	0,73
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 181018 FIX 0.0	EUR	-50 000 000	-50 045 626,60	-0,73
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 190718 FIX 0.0	EUR	12 000 000	12 001 780,16	0,17
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 201118 FIX 0.0	EUR	40 000 000	40 040 787,24	0,58

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 201118 FIX 0.0	EUR	-40 000 000	-40 048 000,00	-0,58
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 261118 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 052 130,82	0,73
VINCI SA ZCP 17-07-18	EUR	60 000 000	60 008 006,48	0,87
VINCI SA 030818 FIX 0.0	EUR	42 000 000	42 011 395,55	0,61
VINCI SA 160818 FIX 0.0	EUR	40 000 000	40 015 261,90	0,58
VINCI SA 180718 FIX 0.0	EUR	20 500 000	20 502 963,55	0,30
TOTAL FRANCE			**2 975 345 682,93**	**43,21**
ITALIE				
UNICREDIT SPA 021118 OIS 0.115	EUR	40 000 000	39 905 780,38	0,58
UNICREDIT SPA 041018 OIS 0.14	EUR	50 000 000	49 895 410,65	0,72
TOTAL ITALIE			**89 801 191,03**	**1,30**
NORVEGE				
TELENOR A.S. 310818 FIX 0.0	EUR	18 000 000	18 008 706,45	0,26
TOTAL NORVEGE			**18 008 706,45**	**0,26**
PAYS-BAS				
DE VOLKSBANK NV 170718 FIX 0.0	EUR	60 000 000	60 008 507,31	0,88
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 010419 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 006 071,53	0,15
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 040119 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 007 755,78	0,29
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 051118 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 005 253,15	0,36
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 0709	EUR	42 000 000	42 000 781,74	0,61
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 080419 FIX 0.0	EUR	13 000 000	13 007 082,73	0,19
TOTAL PAYS-BAS			**170 035 452,24**	**2,48**
ROYAUME UNI				
AVIVA PLC 070918 FIX 0.0	EUR	3 000 000	3 001 211,16	0,04
AVIVA PLC 230818 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 002 710,96	0,07
BARCLAYS BANK PLC 191118 FIX 0.0	EUR	100 000 000	100 066 225,72	1,46
MIZUHO BANK LTD GB ZCP 03-07-18	EUR	25 628 088,38	25 628 285,82	0,37
UBS AG 260918 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 015 568,71	0,36
VODAFONE GROUP PLC 030419 FIX 0.0	EUR	65 000 000	65 111 972,79	0,95
VODAFONE GROUP PLC 030419 FIX 0.0	EUR	-65 000 000	-65 104 000,00	-0,95
TOTAL ROYAUME UNI			**158 721 975,16**	**2,30**
SUEDE				
VATTENFALL AB 230718 FIX 0.0	EUR	12 000 000	12 002 241,81	0,17
VATTENFALL AB 310718 FIX 0.0	EUR	4 000 000	4 001 031,96	0,06
TOTAL SUEDE			**16 003 273,77**	**0,23**
TOTAL Titres de créances négo. sur marchés régl. ou ass.			**3 972 767 381,18**	**57,69**

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
Titres de créances non négociés sur un marché réglementé ou assimilé				
BELGIQUE				
LVMH FINA BELG SA ZCP 17-10-18	EUR	36 000 000	36 039 151,03	0,52
TOTAL BELGIQUE			**36 039 151,03**	**0,52**
ESPAGNE				
FERROVIAL SA 161018 FIX 0.0	EUR	19 000 000	19 010 181,75	0,28
FERROVIAL SA 180718 FIX 0.0	EUR	10 500 000	10 501 260,85	0,15
FERROVIAL SA 231018 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 002 878,45	0,07
FERROVIAL SA 250718 FIX 0.0	EUR	19 000 000	19 003 522,86	0,28
SANT CONS FINA SA ZCP 09-08-18	EUR	30 000 000	30 007 300,31	0,43
SANTANDER CONSUMER FINANCE S.A 100818 FIX 0.0	EUR	11 000 000	11 002 747,22	0,16
TOTAL ESPAGNE			**94 527 891,44**	**1,37**
ETATS UNIS AMERIQUE				
HONEYWELL INTERNATIONAL INC 210918 FIX 0.0	EUR	14 000 000	14 010 719,62	0,20
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 050718 FIX 0.0	EUR	8 500 000	8 500 179,21	0,12
VOLK CRED INC ZCP 12-09-18	EUR	21 179 512,46	21 183 202,23	0,31
TOTAL ETATS UNIS AMERIQUE			**43 694 101,06**	**0,63**
FRANCE				
BFCM (BANQUE F 160718 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 007 298,89	0,73
TOTAL FRANCE			**50 007 298,89**	**0,73**
IRLANDE				
FCA BANK SPA IRISH BRANCH 230718 FIX 0.0	EUR	12 000 000	12 001 820,32	0,17
TOTAL IRLANDE			**12 001 820,32**	**0,17**
LUXEMBOURG				
DH EUROPE FINANCE SA 120918 FIX 0.0	EUR	8 000 000	8 005 124,19	0,12
DH EUROPE FINANCE SA 180918 FIX 0.0	EUR	13 000 000	13 009 020,71	0,19
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 121118 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 033 310,62	0,72
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 121118 FIX 0.0	EUR	-16 000 000	-16 000 000,00	-0,23
TOTAL LUXEMBOURG			**55 047 455,52**	**0,80**
NORVEGE				
TELENOR A.S. 190918 FIX 0.0	EUR	30 000 000	30 019 105,82	0,44
TELENOR A.S. 280818 FIX 0.0	EUR	25 000 000	25 011 487,68	0,36
TOTAL NORVEGE			**55 030 593,50**	**0,80**
PAYS-BAS				
ABB FINANCE BV 180918 FIX 0.0	EUR	40 000 000	40 028 624,14	0,58
AKZO NOBEL NV 030718 FIX 0.0	EUR	11 000 000	11 000 035,12	0,16
AKZO NOBEL NV 050718 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 000 483,45	0,29
DAIMLER INTL FINANCE B.V. 270818 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 001 649,03	0,07
GAS NATU FENO FINA ZCP 11-07-18	EUR	3 500 000	3 500 284,60	0,05
IBERDROLA INTERNATIONAL BV 240718	EUR	36 000 000	36 007 045,70	0,52

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
REPSOL SA 120718 FIX 0.0	EUR	51 000 000	51 004 179,89	0,74
THERMO FISHER SCIENTIFIC 090818 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 006 126,76	0,29
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 010319 FIX 0.0	EUR	2 000 000	2 001 716,98	0,03
VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES NV 271118 FIX 0.0	EUR	8 000 000	8 001 974,53	0,12
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 030419 FIX 0.0	EUR	6 000 000	6 003 350,17	0,09
VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 221018 FIX 0.0	EUR	10 000 000	10 000 000,00	0,15
WHIRLPOOL EUROPE BV 190718 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 003 117,25	0,29
TOTAL PAYS-BAS			**232 558 587,62**	**3,38**
ROYAUME UNI				
BARCLAYS BANK PLC 130319 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 063 616,21	0,73
BARCLAYS BANK PLC 191118 FIX 0.0	EUR	2 000 000	2 002 381,28	0,03
IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC 030918 FIX 0.0	EUR	14 000 000	14 009 196,60	0,20
IMPERIAL BRANDS FINANCE PLC 130818 FIX 0.0	EUR	27 000 000	27 011 284,39	0,39
MIZUHO BANK LTD GB ZCP 05-07-18	EUR	29 875 717,02	29 876 416,49	0,43
RELX PLC 120718 FIX 0.0	EUR	5 000 000	5 000 402,82	0,07
UBS BK OF SWIT LON ZCP 03-10-18	EUR	75 000 000	75 050 507,78	1,10
UBS BK OF SWIT LON ZCP 23-10-18	EUR	30 000 000	30 024 547,87	0,44
UBS BK OF SWIT LON ZCP 23-10-18	EUR	-30 000 000	-30 000 000,00	-0,44
VODAFONE GROUP PLC 040918 FIX 0.0	EUR	35 000 000	35 016 059,10	0,51
VODAFONE GROUP PLC 040918 FIX 0.0	EUR	-35 000 000	-35 000 000,00	-0,51
VODAFONE GROUP PLC 060718 FIX 0.0	EUR	19 000 000	19 000 623,03	0,28
VODAFONE GROUP PLC 100818 FIX 0.0	EUR	27 000 000	27 006 155,46	0,39
TOTAL ROYAUME UNI			**249 061 191,03**	**3,62**
SUEDE				
VATTENFALL AB ZCP 21-08-18	EUR	5 000 000	5 002 189,19	0,07
VATTENFALL AB ZCP 22-08-18	EUR	10 000 000	10 004 465,98	0,15
VATTENFALL AB 150818 FIX 0.0	EUR	4 000 000	4 001 590,21	0,06
VATTENFALL AB 190918 FIX 0.0	EUR	20 000 000	20 014 055,94	0,28
VATTENFALL AB 221118 FIX 0.0	EUR	8 000 000	8 010 341,13	0,12
TOTAL SUEDE			**47 032 642,45**	**0,68**
TOTAL Titres de créances non ng. sur mar. régl. ou ass.			**875 000 732,86**	**12,70**
TOTAL Titres de créances			**4 847 768 114,04**	**70,39**
Organismes de placement collectif				
OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays				
FRANCE				
OSTRUM CASH A1P1 IC	EUR	253,4549	29 684 742,87	0,43

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OSTRUM CASH A1P1 ID	EUR	1	112 561,14	0,00
TOTAL FRANCE			**29 797 304,01**	**0,43**
TOTAL OPCVM et FIA à vocation générale destinés aux non professionnels et équivalents d'autres pays			**29 797 304,01**	**0,43**
TOTAL Organismes de placement collectif			**29 797 304,01**	**0,43**
Créances représentatives de titres prêtés				
ALLEMAGNE				
DAIM E3R+0.53% 12-01-19 EMTN	EUR	10 500 000	10 530 572,50	0,16
DPW 1.5% 09/10/2018	EUR	5 630 000	5 717 408,06	0,08
TOTAL ALLEMAGNE			**16 247 980,56**	**0,24**
BELGIQUE				
ANHEUSERBUSCH INBEV E3R+0.25% 19-10-18	EUR	6 000 000	6 005 400,00	0,09
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 050918 FIX 0.0	EUR	3 000 000	3 000 861,61	0,04
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 191118 FIX 0.0	EUR	13 000 000	13 013 299,59	0,19
TOTAL BELGIQUE			**22 019 561,20**	**0,32**
ESPAGNE				
SANT CONS FIN 1.1% 30-07-18	EUR	4 000 000	4 044 832,11	0,06
TOTAL ESPAGNE			**4 044 832,11**	**0,06**
FRANCE				
CREDIT INDUSTRIEL ET COMMERCIAL 090119 OIS 0.04	EUR	100 000 000	99 829 789,67	1,45
GROUPE AUCHAN 120718 OIS 0.05	EUR	10 500 000	10 488 736,56	0,15
GROUPE AUCHAN 200918 OIS 0.06	EUR	25 000 000	24 980 604,63	0,36
LCL LE E3R+0.27% 19-09-18	EUR	29 000 000	29 018 236,23	0,42
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE E3R+0.1% 26-11-18	EUR	2 500 000	2 503 325,00	0,04
ORANGE 1.875% 09/18	EUR	11 000 000	11 210 279,62	0,16
SOCIETE DES AU 100918 FIX 0.0	EUR	13 000 000	13 008 549,51	0,19
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 181018 FIX 0.0	EUR	50 000 000	50 045 626,60	0,73
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 181018 FIX 0.0	EUR	14 000 000	14 012 775,45	0,20
VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 201118 FIX 0.0	EUR	40 000 000	40 048 000,00	0,58
TOTAL FRANCE			**295 145 923,27**	**4,28**
LUXEMBOURG				
INTESA SANPAOLO BANK LUXEMBOURG SA 121118 FIX 0.0	EUR	16 000 000	16 000 000,00	0,23
TOTAL LUXEMBOURG			**16 000 000,00**	**0,23**
PAYS-BAS				
BMW FIN E3R+0.3% 17-10-18 EMTN	EUR	4 500 000	4 504 117,50	0,07
BMW FIN 0.5% 05-09-18 EMTN	EUR	12 000 000	12 066 706,68	0,17
BMW FINANCE 5%03-18 EMTN	EUR	10 000 000	10 502 314,93	0,15
TOTAL PAYS-BAS			**27 073 139,11**	**0,39**
ROYAUME UNI				
BARCLAYS BANK PLC 191118 FIX 0.0	EUR	18 000 000	18 021 431,49	0,26

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
BG ENERGY 3% 11/18	EUR	19 315 000	19 913 524,22	0,29
UBS BK OF SWIT LON ZCP 23-10-18	EUR	30 000 000	30 000 000,00	0,44
VODAFONE E3R+0.95% 25-02-19 EMTN	EUR	38 887 000	39 138 770,64	0,57
VODAFONE GROUP PLC 030419 FIX 0.0	EUR	65 000 000	65 104 000,00	0,94
VODAFONE GROUP PLC 040918 FIX 0.0	EUR	35 000 000	35 000 000,00	0,51
VODAFONE GROUP PLC 060718 FIX 0.0	EUR	35 000 000	35 001 362,36	0,51
TOTAL ROYAUME UNI			**242 179 088,71**	**3,52**
TOTAL Créances représentatives de titres prêtés			**622 710 524,96**	**9,04**
Indemnités sur titres prêtés			**44 373,51**	**0,00**
Instruments financiers à terme				
Autres instruments financiers à terme				
Swaps de taux				
E3M/0.005/FIX/0.0	EUR	100 000 000	-81 968,26	0,00
E3M/0.066/FIX/0.0	EUR	22 000 000	-12 053,82	0,00
E3M/0.142/FIX/0.0	EUR	80 000 000	-28 457,95	0,00
E3M/0.26/FIX/0.0	EUR	25 000 000	-2 997,59	0,00
E3R/0.019/FIX/0.0	EUR	50 000 000	-81 012,71	0,00
E3R/0.0365/FIX/0.0	EUR	80 000 000	-160 481,49	-0,01
E3R/0.045/FIX/0.0	EUR	75 000 000	-123 332,78	0,00
E3R/0.049/FIX/0.0	EUR	25 000 000	-21 360,38	0,00
E3R/0.051/FIX/0.0	EUR	30 000 000	-47 786,20	0,00
E3R/0.053/FIX/0.0	EUR	18 000 000	-24 373,48	0,00
E3R/0.055/FIX/0.0	EUR	40 000 000	-53 473,91	0,00
E3R/0.057/FIX/0.0	EUR	42 000 000	-49 844,71	0,00
E3R/0.058/FIX/0.0	EUR	50 000 000	-66 265,54	0,00
E3R/0.086/FIX/0.0	EUR	65 000 000	-159 848,90	-0,01
E3R/0.128/FIX/0.0	EUR	50 000 000	-46 959,27	0,00
E3R/0.137/FIX/0.0	EUR	24 500 000	-10 880,50	0,00
E3R/0.137/FIX/0.0	EUR	50 000 000	-90 991,18	0,00
E3R/0.1475/FIX/0.0	EUR	100 000 000	-52 450,72	0,00
E3R/0.171/FIX/0.0	EUR	25 000 000	-22 765,25	0,00
E3R/0.185/FIX/0.0	EUR	25 000 000	-26 902,18	0,00
E3R/0.235/FIX/0.0	EUR	20 000 000	-10 634,11	0,00
E3R/0.241/FIX/0.0	EUR	13 000 000	-9 546,95	0,00
E3R/0.253/FIX/0.0	EUR	8 000 000	-1 094,75	0,00
E3r/0.3085/FIX/0.0	EUR	42 000 000	12 012,51	0,00
E3R/0.309/FIX/0.0	EUR	10 000 000	3 010,56	0,00
OIS/0.0819/FIX/0.0	EUR	13 000 000	-34 487,70	0,00
OIS/0.114/FIX/0.0	EUR	30 000 000	-71 468,08	0,00

Désignation des valeurs	Devise	Qté Nbre ou nominal	Valeur actuelle	% Actif Net
OIS/0.116/FIX/0.0	EUR	11 000 000	-25 927,28	0,00
OIS/0.16/FIX/0.0	EUR	5 000 000	-6 836,72	0,00
OIS/0.171/FIX/0.0	EUR	16 000 000	-10 628,58	0,00
OIS/0.274/FIX/0.0	EUR	6 000 000	-4 898,60	0,00
TOTAL Swap de taux			**-1 324 706,52**	**-0,02**
Swaps de devises				
E3R/0.171/FIX/2.22	EUR	42 881 646,55	42 838 636,26	0,62
E3R/0.171/FIX/2.22	EUR	37 735 849,05	37 697 999,99	0,55
E3R/0.171/FIX/2.22	USD	0	-38 213 214,97	-0,55
E3R/0.171/FIX/2.22	USD	0	-43 424 107,92	-0,63
E3R/0.171/FIX/2.4	EUR	42 358 523	42 285 753,41	0,61
E3R/0.171/FIX/2.4	EUR	42 358 523	42 285 753,41	0,61
E3R/0.171/FIX/2.4	USD	0	-43 392 859,69	-0,63
E3R/0.171/FIX/2.4	USD	0	-43 392 859,69	-0,63
E3R/0.208/FIX/2.92	EUR	49 939 098,64	49 963 679,77	0,73
E3R/0.208/FIX/2.92	USD	0	-53 015 733,80	-0,77
FIX/-0.053/FIX/0.125	EUR	4 919 323,1	4 919 228,06	0,07
FIX/-0.053/FIX/0.125	SEK	0	-4 794 425,85	-0,07
OIS/0.33/FIX/0.0	EUR	33 853 836,06	33 890 917,09	0,49
OIS/0.33/FIX/0.0	USD	0	-33 317 630,94	-0,48
OIS/0.3325/FIX/0.0	EUR	25 673 940,95	25 702 672,59	0,37
OIS/0.3325/FIX/0.0	USD	0	-24 983 940,73	-0,36
OIS/0.335/FIX/0.0	EUR	47 133 430,45	47 186 259,17	0,69
OIS/0.335/FIX/0.0	USD	0	-45 803 891,34	-0,67
TOTAL Swaps de devises			**-3 567 765,18**	**-0,05**
Asset swaps				
E3R 0.0975/FIX 0	EUR	27 000 000	-12 671,84	0,00
E3R 0.237/FIX 0	EUR	10 000 000	-8 390,70	0,00
Asset swaps			**-21 062,54**	**0,00**
TOTAL Autres instruments financiers à terme			**-4 913 534,24**	**-0,07**
TOTAL Instruments financiers à terme			**-4 913 534,24**	**-0,07**
Créances			**13 385 467,03**	**0,19**
Dettes			**-2 166 589,56**	**-0,03**
Comptes financiers			**373 329 708,84**	**5,42**
Actif net			**6 887 641 750,72**	**100,00**

NATIXIS CASH EURIBOR R	**EUR**	**10 228,0919**	**41 388,68**
NATIXIS CASH EURIBOR I	**EUR**	**63 028,9227**	**102 560,12**
NATIXIS CASH EURIBOR RE	**EUR**	**59,5764**	**1 013,02**