

**AVISO A LOS PARTICIPES DE LOS FI**

OSTRUM SRI CASH

OSTRUM SRI MONEY

OSTRUM SRI MONEY 6M

OSTRUM SRI MONEY PLUS

OSTRUM EURO LIQUIDITY LVNAV

**Y A LOS ACCIONISTAS DE LA SICAV**

OSTRUM SRI CASH PLUS

París, 10 de abril de 2026

La Directiva (UE) 2024/927 del Parlamento Europeo y del Consejo, de 13 de marzo de 2024, por la que se modifican la Directiva OICVM y la Directiva GFIA, prevé el despliegue generalizado de instrumentos de gestión de la liquidez en los OICVM y los FIA europeos. El objetivo de este texto es mejorar y armonizar el uso de estos instrumentos en la Unión Europea y permitir así una mayor protección de los inversores en caso de crisis o tensiones en los mercados.

En este contexto, y teniendo en cuenta la naturaleza de los fondos mencionados anteriormente, la sociedad gestora ha decidido añadir un mecanismo de ajuste del valor liquidativo (*swing pricing*) en los siguientes FI y SICAV:

- OSTRUM SRI CASH
- OSTRUM SRI CASH PLUS
- OSTRUM SRI MONEY
- OSTRUM SRI MONEY 6M
- OSTRUM SRI MONEY PLUS

Este mecanismo solo se activará en circunstancias excepcionales del mercado, en particular en caso de un deterioro significativo de la liquidez en los mercados monetarios o de renta fija a corto plazo en los que invierte el Fondo, de perturbaciones importantes en el funcionamiento de dichos mercados, de incrementos acusados de la volatilidad o de aumentos inusuales de los costes de transacción, incluyendo, en especial, la ampliación de los diferenciales de compra-venta o una reducción de la profundidad de mercado. En tales casos, la sociedad gestora podrá proceder a ajustar el valor liquidativo.

El *swing pricing* es un mecanismo mediante el cual el valor liquidativo se ajusta al alza o a la baja cuando el total de las órdenes netas de suscripción/reembolso de los inversores sobre un valor liquidativo supera un umbral preestablecido determinado por la sociedad gestora, con el fin de que los partícipes entrantes o salientes asuman el coste de reorganizar la cartera para gestionar estas entradas y salidas. Este mecanismo protege a los partícipes que permanecen en el fondo.

Asimismo, la política ESG de todos los FI y SICAV se modifica en los siguientes aspectos:

Con la actualización del marco de referencia de la etiqueta ISR (versión V3), se ha ajustado la metodología de seguimiento del universo de comparación ESG de los fondos monetarios con el fin de mejorar su representatividad sin modificar la estrategia de inversión del fondo.

Además, se ha introducido un umbral de materialidad del 5 % del patrimonio neto por categoría de emisores (emisores privados, emisores soberanos y emisores soberanos de bonos verdes), con el fin de aplicar los requisitos de rentabilidad superior en materia de ESG únicamente cuando la exposición a una categoría sea lo suficientemente significativa.

Cuando la inversión en una de las categorías es inferior a este umbral, el análisis ISR puede centrarse en la categoría más representativa, en aras de la coherencia económica y la claridad, sin que ello afecte al perfil de riesgo ni a los objetivos de gestión del fondo.

La descripción de la política ESG se ha simplificado en el folleto. Ahora se detalla con mayor precisión en el anexo precontractual (con referencias al anexo en el folleto). Este punto no implica ningún cambio en la comunicación de los FI y SICAV en el sentido de la posición 2020-03 de la AMF sobre criterios ESG; la comunicación sigue siendo fundamental (el enfoque se basa en un compromiso significativo en la gestión).

### **Dichas modificaciones surtirán efecto el 16 de abril de 2026.**

La documentación legal (los documentos de datos fundamentales o DDF, así como el folleto y los reglamentos) de los OIC están disponibles en Natixis Investment Managers International: [www.im.natixis.com](http://www.im.natixis.com).

Puede recibir dicha documentación en el plazo de ocho días hábiles si lo solicita por escrito a:

#### **NATIXIS INVESTMENT MANAGERS INTERNATIONAL**

Service Clients

43, avenue Pierre Mendès-France

75013 PARIS

Correo electrónico: [clientservicingAM@natixis.com](mailto:clientservicingAM@natixis.com)