

Paris, le 23 avril 2024

AVIS INTERNET AUX PORTEURS DU FONDS
OSTRUM SRI CASH A1 P1

Part	Code ISIN	Part	Code ISIN
I(C)	FR0010322438	I(D)	FR0010731463
SOPRANE	FR0011034735		

Nous vous informons que des modifications seront apportées à la documentation juridique de OSTRUM SRI CASH A1 P1 (le « Fonds ») :

1. Evolution du label ISR

Dans le cadre de l'évolution du label ISR, les modifications sont les suivantes :

- Application des politiques ESG mises en place (de manière non exhaustive) : politiques sectorielles ; politiques d'exclusion ; politiques de gestion des controverses.
- Sélectivité ESG des émetteurs en portefeuille mise en place par catégorie d'émetteurs.
- Analyse ISR du Fonds sur 90% minimum de l'actif net, calculé sur les titres éligibles à l'analyse ISR : titres de créance émis par des émetteurs privés et quasi-publics ainsi que des émetteurs souverains verts et assimilés souverains :
 - *pour les émetteurs privés*, la notation extra financière repose sur 4 piliers :
 - gouvernance responsable,
 - gestion durable des ressources,
 - transition énergétique
 - développement des territoires
 - *pour les émetteurs assimilés souverains* (agences garanties, agences supranationales, collectivités locales et Green bonds), la notation extra financière se fonde sur les Objectifs du Développement Durable lesquels désignent les dix-sept objectifs établis par les États Membres de l'Organisation des Nations Unies (ONU), afin de guider la collaboration internationale vers le développement durable.
- Application d'un processus de sélection ISR : au terme de l'analyse de l'univers d'investissement, les titres sont sélectionnés en fonction de leurs caractéristiques

financières et extra financières. Le processus de gestion ISR sélectionne ainsi les émetteurs en adoptant une approche dite de « note moyenne », visant à surperformer l'univers d'investissement initial filtré de 20% des émetteurs les moins bien notés ESG en poids, pour chacune des deux catégories.

Les émetteurs assimilés souverains et émetteurs privés sont en ensuite répartis en deux sous-univers, à partir desquels sont calculés :

- *L'univers ISR des émetteurs privés* et sa note moyenne ESG :
 - En lien avec le process ISR monétaire traditionnel de la gestion, les émetteurs privés sont notés de 1 à 10, 1 étant la meilleure note.
 - Filtrage de 20% des émetteurs les moins bien notés et calcul des notes ESG équipondérées entre les émetteurs.
 - Note moyenne équipondérée des notes.

- *L'univers d'investissement initial des émetteurs assimilés souverains* et sa performance moyenne ESG :
 - Émetteurs inclus : collectivités locales, agences garanties, agences supranationales et Green bonds.
 - Filtrage de 20% des émetteurs les moins bien notés (SDG index) pour le calcul de la note moyenne.
 - Note moyenne équipondérée entre les émetteurs.

Avec cette approche du score moyen de l'univers d'investissement, le gérant du Fonds met en place la stratégie ISR du portefeuille.

2. Investissements durables

Le Fonds détiendra désormais une proportion minimale de 20% d'investissements durables.

3. Montant minimum de souscription initiale des parts I

Un montant minimum de souscription initiale de 100 000 euros sera désormais applicable pour les parts IC (FR0010322438) et ID (FR0010731463).

Ces modifications seront effectives le **30 avril 2024**.

La documentation juridique (documents d'informations clés (DIC) et prospectus) est disponible auprès de Natixis Investment Managers International et sur le site www.im.natixis.com.



Elle peut vous être adressée dans un délai de huit jours ouvrés sur simple demande écrite auprès de :

Natixis Investment Managers International

Service Clients

43, avenue Pierre Mendès-France

75013 PARIS

ou de ClientServicingAM@natixis.com