Informations périodiques pour les produits financiers visés à l'article 8, paragraphes 1, 2 et 2 *bis*, du règlement (UE) 2019/2088 et à l'article 6, premier alinéa, du règlement (UE) 2020/852

Dénomination du produit: OSTRUM SRI CASH PLUS
Identifiant d'entité juridique : 969500PKFU9JCKUX4592

Caractéristiques environnementales et/ou sociales

Ce produit financier a-t-il un objectif d'investissement durable ?

●● ☐ **Oui** | ●○ ☒ **Non**

☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif environnemental :** ___%

- ☐ dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
- ☐ dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE

☐ Il a réalisé des **investissements durables ayant un objectif social :** ___%

☐ Il promouvait des **caractéristiques environnementales et/ou sociales (E/S)** et bien qu'il n'ait pas eu d'objectif d'investissement durable, il présentait une proportion de ___ % d'investissements durables.

- ☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui sont considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
- ☐ ayant un objectif environnemental et réalisés dans des activités économiques qui ne sont pas considérées comme durables sur le plan environnemental au titre de la taxinomie de l'UE
- ☐ ayant un objectif social

☒ Il promouvait des caractéristiques E/S, mais **n'a pas réalisé d'investissements durables**

Par **investissement durable**, on entend un investissement dans une activité économique qui contribue à un objectif environnemental ou social, pour autant qu'il ne cause de préjudice important à aucun de ces objectifs et que les sociétés dans lesquelles le produit financier a investi appliquent des pratiques de bonne gouvernance.

La **taxinomie de l'UE** est un système de classification institué par le règlement (UE) 2020/852, qui dresse une liste **d'activités économiques durables sur le plan environnemental**. Ce règlement ne comprend pas de liste des activités économiques durables sur le plan social. Les investissements durables ayant un objectif environnemental ne sont pas nécessairement alignés sur la taxinomie.

Dans quelle mesure les caractéristiques environnementales et/ou sociales promues par ce produit financier ont-elles été atteintes ?

La SICAV a promu des caractéristiques environnementales et sociales. Ces caractéristiques reposent sur les éléments suivants :

- Exclure les secteurs et les émetteurs controversés grâce aux politiques sectorielles, d'exclusion et de gestion des controverses du gérant financier par délégation ;
- Sélectionner les émetteurs les mieux notés selon une note ESG en excluant 20% des émetteurs les moins bien évalués ESG (y compris les émetteurs les plus controversés d'après les politiques d'exclusion et sectorielle d'Ostrum et les émetteurs les moins bien notés)

Ces calculs sont réalisés hors actifs non éligibles au sens du label ISR.

Aucun indice de référence n'a été désigné dans le but d'atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par la SICAV

Les **indicateurs de durabilité** permettent de mesurer la manière dont les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier sont atteintes.

Quelle a été la performance des indicateurs de durabilité ?

Non-Applicable.

Quels étaient les objectifs des investissements durables que le produit financier entendait notamment réaliser et comment les investissements durables y ont-ils contribué ?

Non Applicable

Les **principales incidences négatives** correspondent aux incidences négatives lesplus significatives des décisions d'investissement sur lesfacteurs de durabilité liés aux questions environnementales, sociales et de personnel, au respect des droits de l'homme et à la lutte contre la corruption et les actes de corruption.

Dans quelle mesure les investissements durables que le produit financier a notamment réalisé n'ont-ils pas causé de préjudice important à un objectif d'investissement durable sur le plan environnemental ou social ?

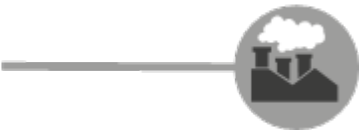
Non Applicable

Comment les indicateurs concernant les incidences négatives ont-ils été pris en considération ?

Non Applicable

Les investissements durables étaient-ils conformes aux principes directeurs de l'OCDE à l'intention des entreprises multinationales et aux principes directeurs des Nations unies relatifs aux entreprises et aux droits de l'homme ? Description détaillée :

Non Applicable



Comment ce produit financier a-t-il pris en considération les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité ?

La SICAV a pris en compte les 14 principales incidences négatives listées à l'annexe 1 relative à la déclaration des principales incidences négatives sur la durabilité du Règlement délégué (UE) 2022/1288 du 6 avril 2022. Des informations sur les principales incidences négatives sur les facteurs de durabilité sont disponibles dans le rapport périodique de la SICAV conformément à l'article 11(2) du règlement SFDR et sur le site internet d'Ostrum (www.ostrum.com) rubrique "ESG".

Quels ont été les principaux investissements de ce produit financier ?

Merci de vous référer au Top15 Investissement ci-dessous :

La liste comprend les investissements constituant **la plus grande proportion d'investissements** du produit financier au cours de la période de référence, à savoir : 01/07/2022 - 30/06/2023

Investissements les plus importants	Secteur	% d'actifs	Pays
OSTRUM SRI CASH M (C/D) EUR	OPC Monétaires	4.35	France
OSTRUM SRI CASH A1P1.ICEUR	OPC Monétaires	3.05	France
PURPLE PROTECTED TR 17-11-23	Finance - Autres services	2.60	Luxembourg
ENEL FI.NV 29-09-23	Electricité - Intégrée	1.96	Pays-Bas

SG ISSUER ESTRC +3 BP 27-02-24	Services de conseil	1.88	Luxembourg
EMTN SOGEIS ESTRC +7.50 % 05-02-24	Services de conseil	1.41	Luxembourg
BBVA 15-09-23	Banques commerciales Non-US	1.15	Espagne
PURPLE PROTECTED TR 18-10-23	Finance - Autres services	0.95	Luxembourg
SOC.GE.PAR. 05-09-23 ESTR+15BP (31-03-23	Institution bancaire diversifiée	0.94	France
ENGIE 14-08-23 ESTER+15BP (13-04-23)	Electricité - Géneration	0.94	France
BQ POST. 22-01-24 ESTRC+19BP (09-06-23)	Banques commerciales Non-US	0.93	France
SG ISSUE TV 17-06-24	Services de conseil	0.93	Luxembourg
CA CONS.FI. 31-10-23 ESTR+15BP (30-06-23	Finance - Prêts à la consommation	0.93	France
BNP PARIBAS 04-07-23	Institution bancaire diversifiée	0.93	France
BFCM 07-08-23	Banques commerciales Non-US	0.93	France

Le pays affiché est le pays de risque.

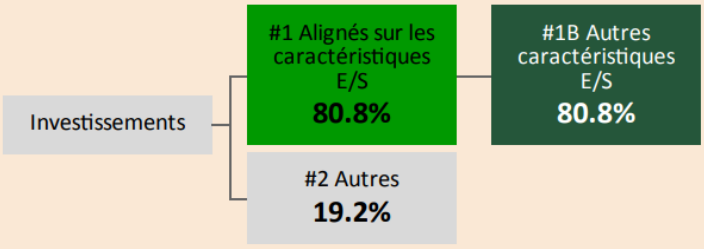
L'allocation des actifs décrit la part des investissements dans des actifs spécifiques.

Quelle était la proportion d'investissements liés à la durabilité ?

Non Applicable

Quelle était l'allocation des actifs ?

Au 30 juin 2023, le fonds a investi 80.8% de son actif net sur des titres alignés avec les caractéristiques Environnementales et Sociales (#1Alignés sur les caractéristiques E/S). Par conséquent, le fonds a investi 19.2% de son actif net dans la catégorie #2. Autres.



La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** inclut les investissements du produit financier utilisés pour atteindre les caractéristiques environnementales ou sociales promues par le produit financier.

La catégorie **#2 Autres** inclut les investissements restants du produit financier qui ne sont ni alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales ni considérés comme des investissements durables.

La catégorie **#1 Alignés sur les caractéristiques E/S** comprend :

- La sous-catégorie **#1A Durables** couvrant les investissements durables ayant des objectifs environnementaux ou sociaux.
- La sous-catégorie **#1B Autres caractéristiques E/S** couvrant les investissements alignés sur les caractéristiques environnementales ou sociales qui ne sont pas considérés comme des investissements durables.

Dans quels secteurs économiques les investissements ont-ils été réalisés ?

Tous les secteurs économiques appartenant à l'univers d'investissement à l'exception de ceux faisant l'objet d'exclusions, conformement aux politiques d'exclusions appliquées au fonds

Pour être conforme à la taxonomie de l'UE, les critères applicables au **gaz fossile** comprennent des limitations des émissions et le passage à l'électricité d'origine intégralement renouvelable ou à des carburants à faible teneur en carbone d'ici à la fin 2035. En ce qui concerne l'**énergie nucléaire**, les critères comprennent des règles complètes en matière de sûreté nucléaire et de gestion des déchets.

Les **activités habilitantes** permettent directement à d'autres activités decontribuer de manière substantielle à la réalisation d'un objectif environnemental.

Les **activités transitoires** sont des activités pour lesquelles il n'existe pas encore de solutions de remplacement sobres en carbone et, entre autres, dont les niveaux d'émission de gaz à effet de serre correspondent aux meilleures performances réalisables.

Dans quelle mesure les investissements durables ayant un objectif environnemental étaient-ils alignés sur la taxinomie de l'UE ?

Non Applicable

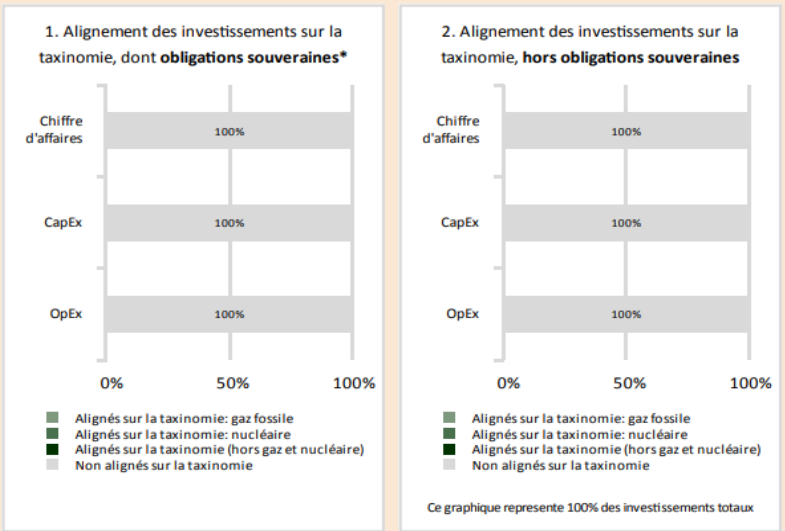
Le produit financier a-t-il investi dans des activités liées au gaz fossile et/ou à l'énergie nucléaire conformes à la taxinomie de l'UE [1]?

☐ Oui

☐ Dans le gaz ☐ Dans l'énergie nucléaire

☒ Non

Les graphiques ci-dessous font apparaître en vert le pourcentage d'investissements qui étaient alignés sur la taxinomie de l'UE. Étant donné qu'il n'existe pas de méthodologie appropriée pour déterminer l'alignement des obligations souveraines* sur la taxinomie, le premier graphique montre l'alignement sur la taxinomie par rapport à tous fes investissements du produit financier, y compris les obligations sauveraines, tandis que le deuxième graphique représente l'alignement sur la taxinomie uniquement par rapport aux investissements du produit financier autres que les obligations souveraines.



**Aux fins de ces graphiques, les «obligations souveraines» comprennent toutes les expositions souveraines.*

1 Les activités liées au gaz fossile et/ou au nucléaire ne seront conformes à la taxinomie de l'UE que si elles contribuent à limiter le changement climatique (« atténuation du changement ») et ne causent de préjudice important à aucun objectif de la taxinomie de l'UE – voir la note explicative dans la marge de gauche. L'ensemble des critères applicables aux activités économiques dans les secteurs du gaz fossile et de l'énergie nucléaire qui sont conformes à la taxonomie de l'UE sont définis dans le règlement délégué (UE) 2022/1214 de la Commission.

A la date du reporting, compte tenu des données reportées/estimées par les émetteurs, la société de gestion n'a pas identifié d'alignement taxonomie gaz et nucléaire dans le portefeuille d'investissement.

- ***Quelle était la proportion d'investissements réalisés dans des activités transitoires et habilitantes ?***

La part minimale d'investissements durables ayant un objectif environnemental aligné sur la taxonomie est de 0%. Par conséquent, la part minimale des investissements dans des activités transitoires et habilitantes au sens du Règlement européen sur la taxonomie est donc également fixée à 0 %.

Quelle était la proportion d'investissements durables ayant un objectif environnemental qui n'étaient pas alignés sur la taxinomie de l'UE ?

La SICAV a promu des caractéristiques environnementales et sociales mais ne s'engage pas à réaliser des investissements durables. Par conséquent, le fonds ne s'engage pas sur une part minimale d'investissements durables avec un objectif environnemental qui ne sont pas alignés sur la Taxonomie de l'UE.

Le symbole représente des investissements durables ayant un objectif environnemental qui **ne tiennent pas compte des critères** en matière d'activités économiques durables sur le plan environnemental au titre du règlement (UE) 2020/852.

Quelle était la proportion d'investissements durables sur le plan social ?

Non Applicable

Quels étaient les investissements inclus dans la catégorie « autres », quelle était leur finalité, et des garanties environnementales ou sociales minimales s'appliquaient-elles à eux?

Les investissements suivants sont inclus dans « #2 autres » : la dette souveraine, les liquidités, les OPC monétaires, les contrats à terme (dérivés) négociés sur des marchés réglementés ou de gré à gré uniquement à titre de couverture, les prises en pension pour la gestion de trésorerie et l'optimisation des revenus et de la performance de la SICAV.
Les informations sur liste des catégories d'actifs et instruments financiers utilisés et

leur utilisation se trouvent dans ce prospectus à la rubrique « « Description des catégories d'actifs et des instruments financiers dans lesquels l'OPCVM entend investir ».
Les garanties environnementales ou sociales minimales ne sont pas systématiquement appliquées

Quelles mesures ont été prises pour atteindre les caractéristiques environnementales et/ou sociales au cours de la période de référence ?

En respect avec l'application des modèles, les équipes de gestion ont systématiquement intégré des considérations environnementales, sociales et de gouvernance dans le process de sélection des investissements. Un suivi régulier de l'évolution des notations extra-financières des titres est réalisé afin de s'assurer qu'aucun des investissements ne contrevient avec la philosophie ESG du fonds

Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?

Non Applicable

Les **indices de référence** sont des indices permettant de mesurer si le produit financier atteint les caractéristiques environnementales ou sociales qu'il promeut.

- ***En quoi l'indice de référence diffère-t-il d'un indice de marché large ?***

  Non Applicable

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier au regard des indicateurs de durabilité visant à déterminer l'alignement de l'indice de référence sur les caractéristiques environnementales ou sociales promues ?***

  Non Applicable

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de référence ?***

  Non Applicable

- ***Quelle a été la performance de ce produit financier par rapport à l'indice de marché large ?***

  Non Applicable