

**TROISIEME SUPPLEMENT EN DATE DU 2 OCTOBRE 2023 AU PROSPECTUS DE BASE EN DATE
DU 14 AVRIL 2023**



CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS

Programme d'admission aux négociations Titres Négociables à Moyen Terme

de 1.500.000.000 d'euros

Le présent troisième supplément (le "**Troisième Supplément**") qui a obtenu le numéro d'approbation 23-417 en date du 2 octobre 2023 par l'Autorité des marchés financiers (l'"**AMF**") complète, et doit être lu conjointement avec le prospectus de base du 14 avril 2023 (le "**Prospectus de Base**") ayant reçu le numéro d'approbation 23-117 par l'AMF le 14 avril 2023, le premier Supplément qui a obtenu le visa n°23-158 en date du 15 mai 2023 par l'AMF (le "**Premier Supplément**") et le second Supplément qui a obtenu le visa n°23-286 en date du 6 juillet 2023 par l'AMF (le "**Second Supplément**") préparé par la Caisse des dépôts et consignations (l'"**Emetteur**" ou la "**Caisse des Dépôts**") et relatif à son programme d'admission aux négociations sur un Marché Réglementé de Titres Négociables à Moyen Terme (le "**Programme**").

Ce Troisième Supplément a été approuvé par l'AMF, en tant qu'autorité compétente au titre du règlement (UE) 2017/1129, tel que modifié le cas échéant (le "**Règlement Prospectus**"). Ce Troisième Supplément a été préparé conformément à l'article 23 du Règlement Prospectus. Le Prospectus de Base (tel que complété par le Premier Supplément, le Second Supplément et ce Troisième Supplément) constitue un prospectus de base au sens de l'article 8 du Règlement Prospectus.

Les termes définis dans le Prospectus de Base ont la même signification lorsqu'ils sont utilisés dans ce Troisième Supplément.

Ce Troisième Supplément modifie et complète le Prospectus de Base.

Des copies de ce Troisième Supplément et des documents incorporés par référence sont disponibles sans frais au siège de l'Emetteur et seront également disponibles sur le site internet de l'Emetteur (www.caissedesdepots.fr) et sur le site internet de l'AMF (www.amf-france.org).

Sous réserve des informations figurant dans le Troisième Supplément, aucun fait nouveau significatif, erreur ou inexactitude substantielle concernant les informations contenues dans le Prospectus de Base (tel que complété par le Premier Supplément, le Second Supplément et ce Troisième Supplément) qui serait de nature à influencer significativement l'évaluation des Titres n'est survenu ou n'a été constaté depuis la publication du Prospectus de Base.

Dans l'hypothèse d'une contradiction entre (a) toute déclaration faite dans ce Troisième Supplément et (b) toute autre déclaration contenue ou incorporée par référence dans le Prospectus de Base, le Premier Supplément ou le Second Supplément, les déclarations du Troisième Supplément prévaudront.

Ce Troisième Supplément a été préparé afin d'incorporer par référence les comptes consolidés intermédiaires 2023 et les comptes sociaux intermédiaires 2023 de la section générale de l'Emetteur. Il en résulte que certaines modifications des sections « Documents incorporés par référence » et « Informations Générales » du Prospectus de Base ont été nécessaires.

Table des Matières

INCORPORATION PAR REFERENCE	4
INFORMATIONS GENERALES	6
RESPONSIBILITE DU TROISIEME SUPPLEMENT	7

INCORPORATION PAR REFERENCE

La section « DOCUMENTS INCORPORES PAR REFERENCE » apparaissant aux pages 24 à 29 du Prospectus de Base est modifiée comme suit :

- Le mot « et » à la fin de paragraphe (b) est supprimé ;
- Le « . » à la fin du paragraphe (c) est remplacé par « ; et » ;
- Le paragraphe suivant est ajouté à la suite du paragraphe (c):

« (d) les sections citées dans le tableau ci-après extraites des comptes consolidés intermédiaires 2023 et des comptes sociaux intermédiaires 2023 de la section générale et les rapports de revue limitée des commissaires aux comptes de l’Emetteur pour la période se terminant le 30 juin 2023 (en langue française) déposé auprès de l’AMF (les « **Comptes Intermédiaires 2023** ») (<https://www.caissedesdepots.fr/sites/default/files/2023-09/Comptes%20consolid%C3%A9s%20du%20Groupe%20Caisse%20des%20D%C3%A9p%C3%B4ts%20au%2030%20juin%202023%20DEF.pdf> et <https://www.caissedesdepots.fr/sites/default/files/2023-09/ETATS%20FINANCIERS%20SG%2030062023%20DEF.pdf>). »
- Le tableau de correspondance sous le titre « Tableau de correspondance relatif aux documents incorporés par référence : » est amendé pour (i) supprimer entièrement les rubriques (x) 4.1.5 et (y) 11.4.1 et les remplacer avec les suivantes, et (ii) ajouter une nouvelle colonne sous le titre « Comptes Intermédiaires 2023 » relative aux rubriques 4.1.5 et 11.4 .1, comme décrit ci-dessous :

	Annexe 7 du Règlement Délégué (UE) 2019/980	Rapport Financier 2021	Rapport Financier 2022	Rapport d'Activité 2022	Comptes Intermédiaires 2023
4	INFORMATIONS CONCERNANT L'EMETTEUR				
4.1	<u>Histoire et évolution de l'Emetteur:</u>				
4.1.5	tout événement récent propre à l'émetteur et présentant un intérêt significatif pour l'évaluation de sa solvabilité.		pages 12 à 16 et 168-169		Pages 4-9 (comptes consolidés) et pages 7-8 (comptes sociaux de la section générale)

	Annexe 7 du Règlement Délégué (UE) 2019/980	Rapport Financier 2021	Rapport Financier 2022	Rapport d'Activité 2022	Comptes Intermédiaires 2023
11	INFORMATIONS FINANCIÈRES CONCERNANT L'ACTIF ET LE PASSIF, LA SITUATION FINANCIÈRE ET LES RÉSULTATS DE L'ÉMETTEUR				
11.4	<u>Changement significative de la situation financière de l'émetteur</u>				
11.4.1	tout changement significatif de la situation financière du groupe survenu depuis la fin du dernier exercice pour lequel des états financiers audités ou des informations financières intermédiaires ont été publiés, ou fournir une déclaration appropriée indiquant l'absence de tels changements.		pages 16 et 169		Pages 4-135 (comptes consolidés) et pages 4-39 (comptes sociaux de la section générale)

INFORMATIONS GENERALES

Les paragraphes (4), (11) et (13) de la section « Informations Générales » figurant aux pages 90 *et seq.* du Prospectus de Base sont modifiés comme suit :

- (a) Le paragraphe (4) de la section “Informations Générales” est supprimé et remplacé par ce qui suit:

“4. Hormis les informations présentées dans le Troisième Supplément, il n'y a pas eu de changement significatif dans la situation financière ou de performance financière du Groupe (le "**Groupe**" étant l'Emetteur et ses filiales consolidées par intégration fiscale et filiales consolidées par intégration proportionnelle) depuis le 30 juin 2023.”

- (b) Le paragraphe (11) de la section “Informations Générales” est supprimé et remplacé par ce qui suit:

“11. (a) Les comptes consolidés audités de l'Emetteur et les comptes sociaux audités de la section générale de l'Emetteur qui sont incorporés par référence au présent Prospectus de Base, (i) au 31 décembre 2021 ont été audités par Mazars et PricewaterhouseCoopers Audit, et (ii) au 31 décembre 2022 ont été audités par Mazars et KPMG S.A.. Mazars, KPMG S.A. et PricewaterhouseCoopers Audit sont commissaires aux comptes et membres de la Compagnie Régionale des Commissaires aux Comptes de Versailles et du Centre, comme indiqué dans leurs rapports incorporés par référence aux présentes. et (b) les comptes consolidés intermédiaires de l'Emetteur et les états financiers de la section générale pour la période du 1er janvier 2023 au 30 juin 2023 ont fait l'objet d'un examen limité par Mazars et KPMG, commissaires aux comptes et membres de la Compagnie Régionale des Commissaires aux Comptes de Versailles et du Centre, comme indiqué dans leurs rapports incorporés par référence aux présentes.”

- (c) Le paragraphe (13) de la section “Informations Générales” est supprimé et remplacé par ce qui suit :

“13. Aussi longtemps que des Titres admis aux négociations sur un Marché Réglementé dans le cadre du présent Programme seront en circulation,

- (i) tous rapports, courriers et autres documents, informations financières historiques, évaluations et déclarations établis par un expert à la demande de l'Emetteur dont une quelconque partie serait incluse ou à laquelle il serait fait référence dans le présent Prospectus de Base ou dans tout supplément au Prospectus de Base seront disponible sur le site internet de l'Emetteur (www.caissedesdepots.fr) ; et
- (ii) les documents constitutifs de l'Emetteur, autrement dit les articles L. 518-2 et suivants du code monétaire et financier seront disponibles sur le site suivant : www.legifrance.gouv.fr

En outre, aussi longtemps que des Titres émis dans le cadre du présent Programme seront en circulation, les documents figurant au (i) et (ii) ci-dessous seront disponibles sur le site internet de l'AMF (www.amf-france.org) et les documents figurant aux (ii) à (v) seront disponibles sur le site internet de l'Emetteur (www.caissedesdepots.fr):

- (i) les Conditions Définitives relatives à des Titres admis aux négociations sur Euronext Paris ;
- (ii) le présent Prospectus de Base, tout supplément au Prospectus de Base, ainsi que tout nouveau prospectus de base,
- (iii) les documents incorporés par référence au présent Prospectus de Base,
- (iv) tous autres comptes consolidés de l'Emetteur et comptes sociaux de la section générale de l'Emetteur pour les années suivantes, et
- (v) les Comptes Intermédiaires 2023 (incluant les comptes consolidés intermédiaires et les comptes sociaux intermédiaires de la section générale de l'Emetteur).

L'Emetteur publie, dans les délais impartis par la loi française, des comptes annuels consolidés et des comptes annuels sociaux de la section générale audités au 31 décembre de chaque année.”

RESPONSIBILITE DU TROISIEME SUPPLEMENT

Personne qui assume la responsabilité du présent Troisième Supplément au Prospectus de Base

Au nom de l'Emetteur

J'atteste que les informations contenues dans le présent Supplément sont, à ma connaissance, conformes à la réalité et ne comportent pas d'omission de nature à en altérer la portée.

Paris, le 2 octobre 2023

Caisse des dépôts et consignations

56, rue de Lille
75007 Paris
France

Représenté par : Nathalie Tubiana
Directrice des finances et de la politique durable



Le Troisième Supplément au prospectus de base a été approuvé le 2 octobre 2023 par l'AMF, en sa qualité d'autorité compétente au titre du règlement (UE) 2017/1129. L'AMF approuve ce document après avoir vérifié que les informations figurant dans le prospectus de base sont complètes, cohérentes et compréhensibles au sens du règlement (UE) 2017/1129.

Cette approbation ne doit pas être considérée comme un avis favorable sur l'émetteur et sur la qualité des titres financiers faisant l'objet du Troisième Supplément. Les investisseurs sont invités à procéder à leur propre évaluation de l'opportunité d'investir dans les titres financiers concernés.

Le Troisième Supplément au prospectus de base porte le numéro d'approbation suivant : 23-417.

THIS DOCUMENT IS A FREE NON BINDING TRANSLATION, FOR INFORMATION PURPOSES ONLY, OF THE FRENCH LANGUAGE THIRD SUPPLEMENT DATED 6 OCTOBER 2023 WHICH RECEIVED THE APPROVAL NUMBER 23-417 FROM THE *AUTORITE DES MARCHES FINANCIERS* ON 6 OCTOBER 2023 (THE "THIRD SUPPLEMENT"). ONLY THE THIRD SUPPLEMENT WAS GRANTED AN APPROVAL NUMBER BY THE *AUTORITE DES MARCHES FINANCIERS*. IN THE EVENT OF ANY AMBIGUITY OR CONFLICT BETWEEN CORRESPONDING STATEMENTS OR OTHER ITEMS CONTAINED IN THE THIRD SUPPLEMENT AND THIS DOCUMENT, THE RELEVANT STATEMENTS OR OTHER ITEMS CONTAINED IN THE THIRD SUPPLEMENT SHALL PREVAIL. FOR THE AVOIDANCE OF DOUBT, REFERENCES IN THIS DOCUMENT TO THE "THIRD SUPPLEMENT" ARE TO THE "THIRD SUPPLEMENT" AND DO NOT INCLUDE ITS ENGLISH TRANSLATION.

THIRD SUPPLEMENT DATED 6 OCTOBER TO THE BASE PROSPECTUS DATED 14 APRIL 2023



CAISSE DES DEPOTS ET CONSIGNATIONS

(an *établissement spécial* in France)

€1,500,000,000

Titres Négociables à Moyen Terme Admission Programme

This third supplement (the “**Third Supplement**”) which has obtained the approval number 23-417 on 6 July 2023 from the *Autorité des marchés financiers* (the “**AMF**”) is supplemental to and must be read in conjunction with the base prospectus dated 14 April 2023 which was granted the approval number 23-117 on 14 April 2023 by the AMF (the “**Base Prospectus**”) as supplemented by the first supplement dated 15 May 2023 which was granted the approval number 23-158 on 15 May 2023 by the AMF (the “**First Supplement**”) and the second supplement dated 6 July 2023 which was granted the approval number 23-286 on 6 July 2023 by the AMF (the “**Second Supplement**”) prepared by Caisse des dépôts et consignations (“**Caisse des Dépôts**” or the “**Issuer**”) with respect to its €1,500,000,000 *Titres Négociables à Moyen Terme Admission Programme* (the “**Programme**”).

Application has been made for approval of this Third Supplement to the AMF as competent authority under the Regulation (EU) 2017/1129, as amended (the “**Prospectus Regulation**”). This Third Supplement has been prepared for the purpose of Article 23 of the Prospectus Regulation. The Base Prospectus (which includes, for the avoidance of doubt, the First Supplement, the Second Supplement and this Third Supplement) constitutes a base prospectus for the purposes of Article 8 of the Prospectus Regulation.

Terms defined in the Base Prospectus have the same meaning when used in this Third Supplement.

This Third Supplement modifies and completes the Base Prospectus.

Copies of this Third Supplement, together with the documents incorporated by reference herein, can be obtained free of charge from the principal office of the Issuer and will be available on the Issuer’s website (www.caissedesdepots.fr) and the AMF’s website (www.amf-france.org).

Save as disclosed in this Third Supplement, there has been no other significant new factor, material omission or inaccuracy relating to information included in the Base Prospectus (as supplemented by the First Supplement, the Second Supplement and this Third Supplement) which may affect the assessment of the Notes issued under the Programme since the publication of the Base Prospectus.

To the extent that there is any inconsistency between (a) any statement in this Third Supplement and (b) any other statement in or incorporated by reference in the Base Prospectus, the First Supplement or the Second Supplement, the statements in (a) above will prevail.

This Third Supplement has been prepared in order to incorporate by reference the 2023 consolidated half year financial statements (*comptes consolidés*) and the 2023 half year financial statements of the central sector (*comptes sociaux de la section générale*) of the Issuer.

As a result, certain sections “Documents Incorporated by Reference” and “General Information” of the Base Prospectus have been updated accordingly.

Table of Contents

DOCUMENTS INCORPORATED BY REFERENCE	4
GENERAL INFORMATION	6
RESPONSIBILITY FOR THE THIRD SUPPLEMENT	8

DOCUMENTS INCORPORATED BY REFERENCE

The paragraphs under the section of the Base Prospectus entitled “Documents incorporated by reference” on pages 24 to 29 are deleted and replaced with the following:

- The last word “and” in paragraph (b) is deleted;
- The word “and” at the end of paragraph (c) is added and replaces “.”;
- The following paragraph is added below (c):

“(d) the sections referred to in the table below “Cross-reference list relating to information incorporated by reference” which are extracted from the 2023 consolidated half year financial statements (*comptes consolidés*) and the auditors’ limited review report thereon and the 2023 half year financial statements of the central sector (*comptes sociaux de la section générale*) and the auditors’ limited review report thereon of the Issuer for the half-year ending 30 June 2023 (in the French language) filed with the AMF (together the “**2023 Half Year Financial Statements**”) (<https://www.caissedesdepots.fr/sites/default/files/2023-09/Comptes%20consolid%C3%A9s%20du%20Groupe%20Caisse%20des%20D%C3%A9p%C3%B4ts%20au%2030%20juin%202023%20DEF.pdf> and <https://www.caissedesdepots.fr/sites/default/files/2023-09/ETATS%20FINANCIERS%20SG%2030062023%20DEF.pdf>); and ”

The table entitled “Cross-reference list relating to information incorporated by reference:” is amended to (i) delete the item (x) 4.1.5 and (y) 11.4.1 in their entirety and replace them with the following and (ii) add a new column entitled “2023 Half Year Financial Statements” in relation to item 4.1.5 and 11.4.1 as shown below:

	Annex 7 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2019/980, as amended	2021 Financial Report	2022 Financial Report	2022 Business Review	2023 Half Year Financial Statements
4	INFORMATION ABOUT THE ISSUER				
4.1.5	any recent events particular to the issuer and which are to a material extent relevant to an evaluation of the issuer's solvency.		pages 12 to 16 and 168-169		Pages 4-9 (consolidated half year financial statements) and pages 7-8 (half year financial statements of the central sector)
11	FINANCIAL INFORMATION CONCERNING THE ISSUER'S ASSETS AND LIABILITIES, FINANCIAL POSITION AND PROFITS AND LOSSES				
11.4	<u>Significant change in the issuer's financial position</u>				

	Annex 7 of the Commission Delegated Regulation (EU) 2019/980, as amended	2021 Financial Report	2022 Financial Report	2022 Business Review	2023 Half Year Financial Statements
11.4.1	A description of any significant change in the financial position of the group which has occurred since the end of the last financial period for which either audited financial information or interim financial information have been published, or provide an appropriate negative statement.		pages 16 and 169		Pages 4-135 (consolidated half year financial statements) and pages 4-39 (half year financial statements of the central sector)

GENERAL INFORMATION

The paragraphs (4), (11) and (13) of the section "General Information" contained in pages 90 *et seq.* of the Base Prospectus shall be deleted and replaced by the following:

- (a) The paragraph (4) of section "General Information" contained in the Base Prospectus shall be deleted and replaced by the following new paragraph:

“Except the information disclosed in the Third Supplement, there has been no significant change in the financial position or the financial performance of the Group ("**Group**" being the Issuer and its subsidiaries consolidated on a full integration basis (*filiales consolidées par intégration globale*) and a proportional integration basis (*filiales consolidées par intégration proportionnelle*)) since 30 June 2023.”

- (b) The paragraph (11) of section "General Information" contained in the Base Prospectus shall be deleted and replaced by the following new paragraph:

“(a) The audited consolidated financial statements (*comptes consolidés*) of the Issuer and audited annual financial statements of the central sector (*comptes sociaux de la section générale*) of the Issuer incorporated by reference in this Base Prospectus (i) for the year ended 31 December 2021 have been audited by Mazars and PricewaterhouseCoopers Audit and (ii) for the year ended 31 December 2022 have been audited by Mazars and KPMG S.A. Mazars, KPMG S.A. and PricewaterhouseCoopers Audit are statutory auditors and members of the *compagnie régionale des commissaires aux comptes de Versailles et du Centre*, as stated in their reports incorporated by reference herein and (b) the 2023 half year financial statements of the central sector (*comptes sociaux de la section générale*) of the Issuer and the 2023 consolidated half year financial statements (*comptes consolidés*) of the Issuer have been reviewed by Mazars and KPMG S.A., statutory auditors and members of the *compagnie régionale des commissaires aux comptes de Versailles*, as stated in their reports incorporated by reference herein.

- (c) The paragraph (13) of section "General Information" contained in the Base Prospectus shall be deleted and replaced by the following new paragraph:

“For so long as Notes issued under the Programme are outstanding:

- (a) all reports, letters and other documents, valuations and statements prepared by any expert at the Issuer's request any part of which is included or referred to in this Base Prospectus will be available on the website of the Issuer (www.caissedesdepots.fr); and
- (b) the constitutive documents, namely Articles L. 518-2 and *seq.* of the French *Code monétaire et financier* will be available on the following website: www.legifrance.gouv.fr.

In addition, for so long as Notes issued under the Programme are outstanding, the documents listed in (i) and (ii) below will be available on the website of the AMF (www.amf-france.org) and the documents listed from (ii) to (v) on the website of the Issuer (www.caissedesdepots.fr):

- (i) Final Terms relating to Notes which are admitted to trading on Euronext Paris;
- (ii) this Base Prospectus, together with any supplement to this Base Prospectus or further Base Prospectus;

- (iii) the documents incorporated by reference in this Base Prospectus;
- (iv) any further published audited consolidated financial statements (*comptes consolidés*) of the Issuer and audited annual financial statements of the central sector (*comptes sociaux de la section générale*) of the Issuer for following years; and
- (v) the 2023 Half Year Financial Statements (including the consolidated half year financial statements (*comptes consolidés*) and the half year financial statements of the central sector (*comptes sociaux de la section générale*) of the Issuer).

The Issuer publishes, within the time frame imposed by French law, annual audited consolidated financial statements (*comptes consolidés*) and annual audited financial statements of the central sector (*comptes sociaux de la section générale*) as at 31 December in each year.”

RESPONSIBILITY FOR THE THIRD SUPPLEMENT

Individual assuming responsibility for the Third Supplement to the Base Prospectus

In the name of the Issuer

To the best knowledge of the Issuer, the information contained in this Third Supplement is in accordance with the facts and contains no omission likely to affect its import.

Caisse des dépôts et consignations

56, rue de Lille
75007 Paris
France

Represented by Nathalie Tubiana
Directrice des finances et de la politique durable

Executed in Paris on 6 October 2023



Autorité des marchés financiers

This Third Supplement to the Base Prospectus has been approved on 6 October 2023 by the *Autorité des marchés financiers* (the “AMF”), in its capacity as competent authority under Regulation (EU) 2017/1129. The AMF has approved this document after having verified that the information in the Base Prospectus is complete, coherent and comprehensible within the meaning of Regulation (EU) 2017/1129.

This approval should not be considered as a favourable opinion on the Issuer and on the quality of the Notes described in this Third Supplement. Investors should make their own assessment of the opportunity to invest in such Notes.

This Third Supplement to the Base Prospectus has received the following approval number: n°23-417.