

**TROISIEME SUPPLEMENT EN DATE DU 1^{er} OCTOBRE 2024 AU PROSPECTUS DE BASE EN
DATE DU 9 AVRIL 2024**



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 24-420 en date du 1^{er} octobre 2024 par l'Autorité des marchés financiers (l'"**AMF**") complète, et doit être lu conjointement avec le prospectus de base du 9 avril 2024 (le "**Prospectus de Base**") ayant reçu le numéro d'approbation 24-101 par l'AMF le 9 avril 2024, le premier Supplément qui a obtenu le visa n°24-201 en date du 6 juin 2024 par l'AMF (le "**Premier Supplément**") et le second Supplément qui a obtenu le visa n°24-276 en date du 4 juillet 2024 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 2024 et les comptes sociaux intermédiaires 2024 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 (c) est supprimé ;
- Le « ; » à la fin du paragraphe (d) est remplacé par « ; et » ;
- Le paragraphe suivant est ajouté à la suite du paragraphe (d):

« (e) les sections citées dans le tableau ci-après extraites des comptes consolidés intermédiaires 2024 et des comptes sociaux intermédiaires 2024 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 2024 (en langue française) déposé auprès de l’AMF (les « **Comptes Intermédiaires 2024** ») (<https://www.caissedesdepots.fr/sites/default/files/2024-09/Etats%20financiers%20consolid%C3%A9s%20du%20groupe%20Caisse%20des%20D%C3%A9p%C3%B4ts%20au%2030%20juin%202024.pdf>) et (<https://www.caissedesdepots.fr/sites/default/files/2024-09/ETATS%20FINANCIERS%20SG%2030062024.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 2024 » relative aux rubriques 4.1.5 et 11.4 .1, comme décrit ci-dessous :

	Annexe 7 du Règlement Délégué (UE) 2019/980	Rapport Financier 2022	Rapport Financier 2023	Rapport d'Activité 2023	Rapport d'engagement societal 2023	Comptes Intermédiaires 2024
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 11 à 16 et 204 et 205			Pages 4 à 7 (comptes consolidés) et pages 7 et 8 (comptes sociaux de la section générale)

	Annexe 7 du Règlement Délégué (UE) 2019/980	Rapport Financier 2022	Rapport Financier 2023	Rapport d'Activité 2023	Rapport d'engagement societal 2023	Comptes Intermédiaires 2024
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 14 et 205			Pages 4 à 126 (comptes consolidés) et pages 4 à 39 (comptes sociaux de la section générale)

INFORMATIONS GENERALES

Les paragraphes (4), (11) et (13) de la section « Informations Générales » figurant aux pages 93 *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 2024.”

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

“11. Mazars et KPMG S.A. ont (i) vérifié et rendu des rapports d'audit sur les états financiers consolidés et sociaux de l'Emetteur pour les exercices clos le 31 décembre 2022 et le 31 décembre 2023 et (ii) effectué un examen limité des comptes consolidés intermédiaires de l'Emetteur et des états financiers de la section générale pour la période du 1er janvier 2024 au 30 juin 2024. Mazars et KPMG S.A. sont membres de la Compagnie Régionale des Commissaires aux Comptes de Versailles. .”

(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 2024 (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.”

RESPONSABILITE 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 1^{er} octobre 2024

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 1^{er} octobre 2024 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 : 24-420.